

Relatório de acompanhamento mensal da execução da Política de Investimentos

Setembro – 2022

Relatórios alcançados neste documento:

- Relatório mensal de Investimentos (PG V3.3, 3.2.6 (N I));
- Cronograma mensal de Atividades de Gestão de Recursos (PG V3.3, 3.2.6 (N II));
- Relatório de Compatibilidade do P com A (ALM) (PG V3.3, 3.2.6 (N III));
- Relatório semestral de Diligências (PG V3.3, 3.2.6 (N II));
- Relatório de Governança Corporativa (PG V3.3, 3.2.1 (N I));
- Parecer do Comitê de investimentos (PG V3.3, 3.2.6 (N I)).

ÍNDICE

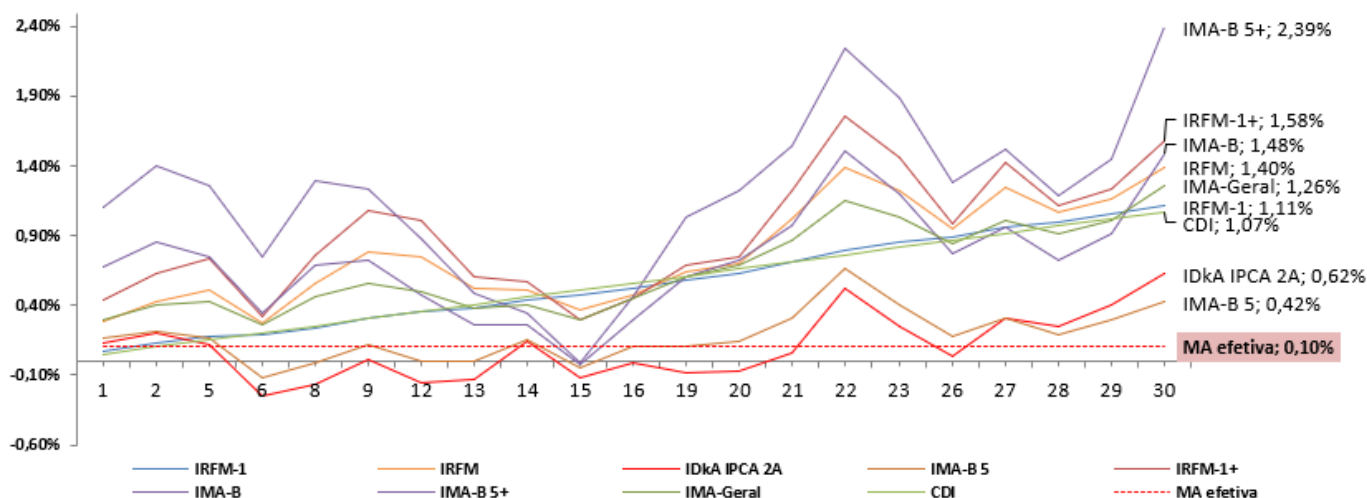
1. Resenha
2. **Relatório mensal de Investimentos**
 - 2.1. Planilha analítica mensal
 - 2.2. Indicadores de desempenho (B3, ANBIMA e IBGE)
 - 2.3. Resumo geral das alocações em R\$
 - 2.4. Resumo geral das alocações em %
 - 2.5. Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante
 - 2.6. Alocações em Renda Fixa, Renda Variável e Investimento no Exterior
 - 2.7. Extrato mensal do desempenho
 - 2.8. Rentabilidade Geral e Meta Atuarial – mensal, ano e estimadas até dez.
 - 2.9. Riscos da carteira
(Portaria 1467/22, art. 108, V, art. 110, I e art. 125 a 136 e Pró Gestão RPPS, item 3.1.1)
3. Carteiras sugeridas CEF e BB
4. Cenário 2022 e 2023 (Juros reais x CDI x M.A.)
5. **Cronograma mensal de Atividades de Gestão de Recursos**
6. **Relatório de Compatibilidade do P com A (ALM)**
 - 6.1. Comparativo Receita Financeira x Receita Atuarial Estimada
7. **Relatório semestral de Diligências**
 - 7.1. Verificação dos ativos que compõem o PL dos FI's e TVM, excluídos TPF
 - 7.2. Situação patrimonial, fiscal e comercial das empresas investidas em FIP
 - 7.3. Rating da RF: (FI, Ativos diretos, FIDC, Crédito Privado e Debêntures de Infraestrutura)
8. **Relatório de Governança Corporativa**
 - 8.1. Evolução da situação atuarial:
 - Custo previdenciário total
 - Evolução do resultado relativo ao equilíbrio financeiro e atuarial e do plano de custeio.
 - 8.2. Gestão de investimentos:
 - Descrição detalhada dos ativos, investimentos, aplicações financeiras e do fluxo de entradas e saídas de recursos.
9. **Parecer do Comitê de Investimentos (ANEXO I)**
10. **Aprovação do Conselho Fiscal (ANEXO II)**

1. Resenha:

Eventos – Setembro.22

O mês de setembro, a nível doméstico, terminou sinalizando a preferência do eleitorado brasileiro pelo candidato da esquerda. Em relatório da Moody's, reconhece que as eleições provavelmente afetarão a trajetória fiscal e econômica do País, tendo em vista as diferenças significativas no compromisso dos principais candidatos com as reformas estruturais. A dúvida sobre se a corrida ao Planalto reforçou a posição conservadora do mercado. A Moody's pontuou que o próximo governo enfrentará impasses de natureza política, taxas de crescimento persistentemente baixas e uma política monetária contracionista que continua a pressionar a capacidade de pagamento de dívida do Brasil. No exterior, Putin anunciou a maior anexação de territórios na Europa desde a II Guerra. Quatro províncias do leste da Ucrânia que representam 15% do território do país. Seguindo o mercado de juros externos quanto ao movimento global de aperto dos juros, aqui no Brasil o Bradesco elevou sua projeção para a taxa dos Fed Funds de 4%-4,25% para 4,75%-5%. Pelo terceiro mês consecutivo ocorreu deflação, de 0,29%. Com isso o IPCA no ano acumula 4,09%, contra um CDI de 8,89% (IPCA+4,6114%aa) e uma meta atuarial de 8,03% (IPCA+3,7852%).

Evolução dos principais indicadores ANBIMA x Meta Atuarial - Setembro/22



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

Valorização Diária:

Setembro 2022	IRFM-1	IDkA Pré 1A	IRFM	IDkA Pré 2A	IDkA IPCA 2A	IMA-B 5	IDkA Pré 3A	IRFM-1+	IMA-B	IMA-B 5+	IMA-Geral
1	0,0676%	0,1094%	0,2903%	0,3666%	0,1326%	0,1652%	0,6251%	0,4365%	0,6719%	1,1082%	0,2950%
2	0,0578%	0,0720%	0,1380%	0,1231%	0,0678%	0,0537%	0,2038%	0,1872%	0,1823%	0,2920%	0,1141%
5	0,0534%	0,0650%	0,0869%	0,0916%	-0,0845%	-0,0511%	0,1142%	0,1074%	-0,1024%	-0,1462%	0,0153%
6	0,0100%	-0,1337%	-0,2472%	-0,4237%	-0,3652%	-0,2860%	-0,5672%	-0,4046%	-0,4003%	-0,4977%	-0,1674%
8	0,0532%	0,0739%	0,2863%	0,3282%	0,0878%	0,1105%	0,6144%	0,4296%	0,3410%	0,5378%	0,2036%
9	0,0678%	0,1281%	0,2264%	0,2642%	0,1713%	0,1238%	0,3946%	0,3235%	0,0279%	-0,0536%	0,0949%
12	0,0401%	-0,0050%	-0,0287%	-0,0746%	-0,1638%	-0,1150%	-0,1073%	-0,0706%	-0,2456%	-0,3568%	-0,0591%
13	0,0335%	-0,0435%	-0,2339%	-0,2781%	0,0185%	-0,0014%	-0,5196%	-0,3973%	-0,2083%	-0,3849%	-0,1104%
14	0,0551%	0,0726%	-0,0041%	0,0427%	0,2785%	0,1557%	-0,0651%	-0,0404%	-0,0052%	-0,1430%	0,0186%
15	0,0354%	-0,0136%	-0,1504%	-0,2123%	-0,2581%	-0,2005%	-0,4059%	-0,2646%	-0,2814%	-0,3510%	-0,1030%
16	0,0461%	0,0398%	0,1118%	0,0942%	0,1025%	0,1485%	0,2004%	0,1522%	0,3217%	0,4718%	0,1494%
19	0,0582%	0,0502%	0,1645%	0,1677%	-0,0718%	0,0038%	0,3275%	0,2300%	0,3074%	0,5696%	0,1591%
20	0,0550%	0,0504%	0,0599%	0,0624%	0,0107%	0,0353%	0,0774%	0,0629%	0,1184%	0,1898%	0,0734%
21	0,0779%	0,1569%	0,3201%	0,3876%	0,1395%	0,1635%	0,5991%	0,4689%	0,2456%	0,3160%	0,1803%
22	0,0833%	0,2599%	0,3625%	0,5278%	0,4554%	0,3588%	0,6332%	0,5334%	0,5354%	0,6865%	0,2831%
23	0,0521%	0,0295%	-0,1610%	-0,1332%	-0,2679%	-0,2604%	-0,4204%	-0,2909%	-0,3074%	-0,3474%	-0,1195%
26	0,0385%	-0,0275%	-0,2753%	-0,3047%	-0,2156%	-0,2241%	-0,6526%	-0,4673%	-0,4256%	-0,5977%	-0,1842%
27	0,0754%	0,1774%	0,2959%	0,4543%	0,2714%	0,1357%	0,6283%	0,4314%	0,1876%	0,2321%	0,1625%
28	0,0381%	-0,0292%	-0,1773%	-0,1921%	-0,0507%	-0,1180%	-0,4193%	-0,3092%	-0,2270%	-0,3204%	-0,0977%
29	0,0535%	0,0691%	0,0954%	0,0693%	0,1430%	0,1046%	0,1336%	0,1212%	0,1829%	0,2501%	0,1004%
30	0,0541%	0,0907%	0,2304%	0,2941%	0,2252%	0,1217%	0,4095%	0,3386%	0,5603%	0,9362%	0,2511%

Valorização Acumulada em ordem de duration:

-0,12; -0,32

-0,29

Setembro .2022	0,5 a.	1 a.	2,1 a.	2 a.	2 a.	2,7 a.	3 a.	2,7 a.	8,8 a.	12,7 a.	3,3 a.	CDI	MA estimada	MA efetiva
	IRFM-1	IDkA Pré 1A	IRFM	IDkA Pré 2A	IDkA IPCA 2A	IMA-B 5	IDkA Pré 3A	IRFM-1+	IMA-B	IMA-B 5+	IMA-Geral			
1	0,0676%	0,1094%	0,2903%	0,3666%	0,1326%	0,1652%	0,6251%	0,4365%	0,6719%	1,1082%	0,2950%	0,0508%	0,29%	0,10%
2	0,1255%	0,1815%	0,4287%	0,4901%	0,2005%	0,2190%	0,8302%	0,6245%	0,8554%	1,4034%	0,4094%	0,1016%	0,29%	0,10%
5	0,1790%	0,2466%	0,5161%	0,5821%	0,1159%	0,1679%	0,9453%	0,7327%	0,7521%	1,2552%	0,4248%	0,1524%	0,29%	0,10%
6	0,1890%	0,1126%	0,2676%	0,1560%	-0,2498%	-0,1186%	0,3727%	0,3251%	0,3488%	0,7513%	0,2567%	0,2033%	0,29%	0,10%
8	0,2423%	0,1865%	0,5547%	0,4847%	-0,1622%	-0,0082%	0,9894%	0,7561%	0,6910%	1,2931%	0,4608%	0,2542%	0,29%	0,10%
9	0,3103%	0,3149%	0,7823%	0,7502%	0,0088%	0,1156%	1,3880%	1,0820%	0,7191%	1,2388%	0,5561%	0,3051%	0,29%	0,10%
12	0,3505%	0,3099%	0,7535%	0,6751%	-0,1550%	0,0004%	1,2791%	1,0106%	0,4717%	0,8776%	0,4967%	0,3561%	0,29%	0,10%
13	0,3841%	0,2663%	0,5178%	0,3951%	-0,1365%	-0,0010%	0,7529%	0,6093%	0,2624%	0,4893%	0,3857%	0,4070%	0,29%	0,10%
14	0,4394%	0,3390%	0,5137%	0,4380%	0,1415%	0,1547%	0,6874%	0,5686%	0,2573%	0,3456%	0,4044%	0,4580%	0,29%	0,10%
15	0,4750%	0,3254%	0,3625%	0,2248%	-0,1169%	-0,0461%	0,2787%	0,3025%	-0,0249%	-0,0066%	0,3010%	0,5090%	0,29%	0,10%
16	0,5214%	0,3653%	0,4747%	0,3192%	-0,0145%	0,1024%	0,4796%	0,4552%	0,2968%	0,4651%	0,4509%	0,5601%	0,29%	0,10%
19	0,5798%	0,4157%	0,6400%	0,4874%	-0,0863%	0,1062%	0,8087%	0,6862%	0,6051%	1,0374%	0,6107%	0,6112%	0,29%	0,10%
20	0,6352%	0,4663%	0,7003%	0,5502%	-0,0756%	0,1416%	0,8867%	0,7496%	0,7242%	1,2291%	0,6846%	0,6623%	0,29%	0,10%
21	0,7136%	0,6239%	1,0226%	0,9399%	0,0637%	0,3053%	1,4911%	1,2220%	0,9716%	1,5490%	0,8661%	0,7134%	0,29%	0,10%
22	0,7975%	0,8855%	1,3888%	1,4727%	0,5194%	0,6653%	2,1338%	1,7619%	1,5122%	2,2461%	1,1517%	0,7645%	0,29%	0,10%
23	0,8500%	0,9153%	1,2255%	1,3376%	0,2501%	0,4031%	1,7044%	1,4659%	1,2001%	1,8909%	1,0308%	0,8157%	0,29%	0,10%
26	0,8889%	0,8875%	0,9468%	1,0288%	0,0340%	0,1781%	1,0407%	0,9918%	0,7695%	1,2819%	0,8447%	0,8669%	0,29%	0,10%
27	0,9649%	1,0665%	1,2455%	1,4878%	0,3055%	0,3141%	1,6755%	1,4275%	0,9585%	1,5171%	1,0086%	0,9181%	0,09%	0,10%
28	1,0034%	1,0370%	1,0661%	1,2928%	0,2547%	0,1957%	1,2491%	1,1139%	0,7294%	1,1918%	0,9099%	0,9694%	0,09%	0,10%
29	1,0575%	1,1068%	1,1625%	1,3630%	0,3980%	0,3006%	1,3843%	1,2364%	0,9136%	1,4449%	1,0112%	1,0207%	0,09%	0,10%
30	1,11%	1,20%	1,40%	1,66%	0,62%	0,42%	1,80%	1,58%	1,48%	2,39%	1,26%	1,07%	0,09%	0,10%

2.1. Relatório mensal de Investimentos

Planilha analítica mensal:

Inicialmente apresentamos a planilha analítica com a rentabilidade mensal de todos os investimentos do IGEPREV, constando: saldo dos investimentos e saldo total, incluindo valores em conta-corrente; a rentabilidade da carteira no mês corrente, no ano e nos últimos 12 meses (quando existe histórico); número de cotistas de cada fundo investido, bem como o PL de cada FI, seus *benchmark*; aderência da Política de Investimentos à atual Resolução com enquadramento, limites e distribuição de alocações; comparação de desempenho da carteira e de cada fundo ao DI e meta atuarial. Este formato permite identificar de forma panorâmica o status da carteira em diversas variáveis ao mesmo tempo. Podemos destacar o desempenho da carteira (0,23%) em relação à meta atuarial (0,10%), e o CDI (1,07%). No mês de setembro o Ibovespa fechou com leve recuperação de 0,47%. A estrapolação no fundo de CDI da CEF, tem motivo pois está aguardando autorização para compra de NTN-B em um fundo com baixa volatilidade.

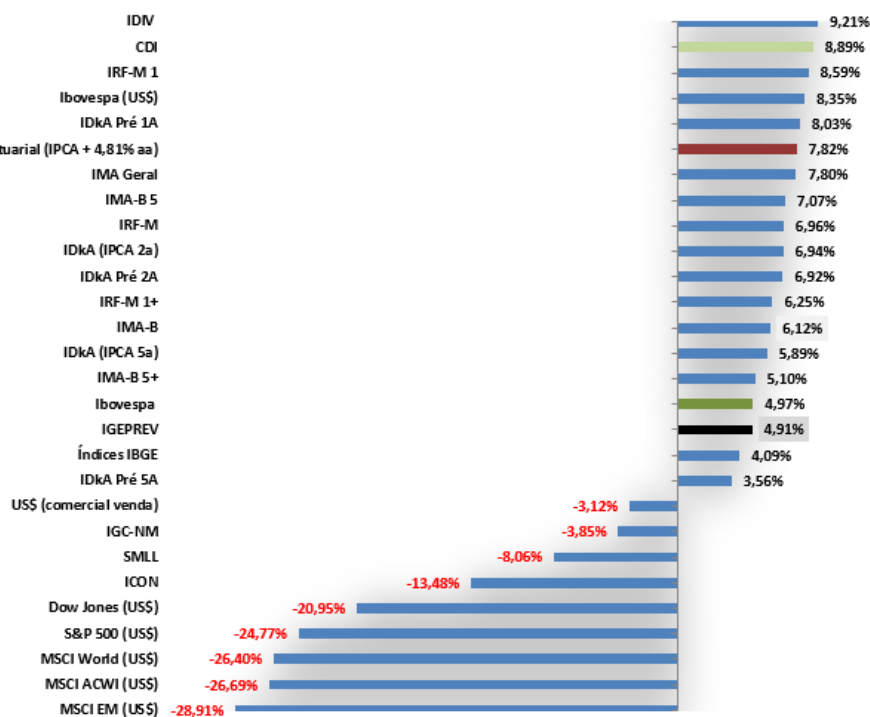
Resolução 4.963/2021		PAI	Set.2022	R\$	mês	ano	12 m	CDI	M.A.
				183.851.619,61	0,23%	4,91%	4,70%	1,07%	0,10%
RENDA FIXA		100,00%	73,82%	135.720.530,92					
art. 7º, I, b (FI 100% TTN)		100%	100%	3.050.863,74					
1	BB Previdenciário FI RF TP IPCA I (15.08.22)			2.781.197,26	1,05%	10,55%	12,58%	-	-
2	BB Previdenciário FI RF TP IPCA III (15.08.24)			269.666,48	0,48%	7,72%	9,75%	-	-
art. 7º, III, a (FI geral) (ATIVO)		60%	60%	130.588.679,50					
3	BB Previdenciário RF Perfil FIC			4.761.992,39	1,09%	9,08%	11,18%	-	-
4	BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário			2.067.942,03	1,25%	7,50%	9,00%	-	-
5	Caixa Brasil Disponibilidades RF FI			8.695.183,81	0,93%	7,61%	9,21%	-	-
6	Caixa Brasil Ref. DI FI LP		60,50%	111.223.649,07	1,11%	9,12%	11,18%	-	-
7	Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC			575.441,40	1,28%	8,63%	10,29%	-	-
8	Caixa Brasil Título Público FI RF LP			3.264.470,80	1,09%	9,03%	11,10%	-	-
art. 7º, V, a (FIDC Fechado)		5%	5,00%	2.080.987,68					
9	BBIF Master FIDC LP			678.395,31	-0,33%	-5,28%	-6,22%	-	-
10	LME IPCA FIDC Multissetorial Senior			1.402.592,37	0,26%	2,95%	3,77%	-	-
RV + ESTRUTURADOS + IMOBILIÁRIO		30,00%	20,53%	37.749.451,62					
art. 8º, I (FIA)		30%	30,00%	20.555.664,83					
11	BNB Seleção FIA			2.212.620,86	0,43%	10,00%	7,16%	-	-
12	Caixa Brasil IBX 50 FIA			1.854.010,29	0,32%	3,65%	-2,13%	-	-
13	Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS			4.716.915,83	-0,09%	8,36%	4,58%	-	-
14	Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)			2.124.301,51	1,28%	9,36%	2,62%	-	-
15	Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico			3.748.647,03	-3,22%	3,35%	2,20%	-	-
16	Caixa FIC FIA Multigestor			4.057.538,75	-0,69%	2,56%	-8,05%	-	-
17	Caixa FIA SMALL CAPS Ativo			1.841.630,56	-1,94%	-8,24%	-18,90%	-	-
art. 10, I (Multimercado)		8,09%	10,00%	13.001.069,26					
18	Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP			4.099.741,89	1,41%	9,11%	10,03%	-	-
19	Caixa Brasil Estratégia Livre FIC Multimercado LP			3.414.270,13	2,23%	11,46%	12,47%	-	-
20	Caixa Bolsa Americana FI Multimercado LP			4.588.433,60	-8,62%	-19,76%	-9,27%	-	-
21	Caixa FIM RV 30 LP			608.648,42	1,48%	10,32%	10,21%	-	-
22	FIC FI Capital Protegido Bolsa de Valores V Multimercado	15%		289.975,22	1,60%	-3,08%	-	-	-
art. 10, II (FIP)		5,00%	1,02%	1.879.655,39					
23	Ático Florestal FIC FIP			1.879.655,39	-0,04%	-	-	-	-
art. 11 (Imobiliário)		5%	5,00%	2.313.062,14					
24	HAZ FII (Ático Renda FII)			2.313.062,14	0,00%	-	-	-	-
EXTERIOR		10,00%	5,65%	10.381.637,07					
art. 9º, II		10,00%	3,49%	6.413.884,75					
25	CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE			262.609,92	-6,19%	-35,21%	-32,57%	-	-
26	BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)			4.447.854,84	-5,29%	-25,46%	-17,90%	-	-
27	BB Nordea Invest. Ext. FIM			1.703.419,99	-4,21%	-20,07%	-15,14%	-	-
art. 9º, III		10,00%	2,16%	3.967.752,32					
28	BB Ações Bolsas Europeias ETF FIC Ações BDR Nível I			1.139.585,62	-8,25%	-25,52%	-21,20%	-	-
29	BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nível I			1.283.558,36	-7,95%	-20,44%	-13,90%	-	-
30	Caixa FIA Institucional BDR Nível I			1.544.608,34	-7,72%	-30,97%	-22,81%	-	-
Total da carteira		94,35%		183.851.619,61					
Saldo em c/c									
Total Geral da carteira		100,00%		183.851.619,61					
Renda Fixa		73,82%		135.720.530,92					
RV + Estruturados + Imobiliário		20,53%		37.749.451,62					
Exterior		5,65%		10.381.637,07					

2.2. Relatório mensal de Investimentos

Indicadores de desempenho (B3, ANBIMA e IBGE):

Indicadores		2022	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set
US\$ (comercial venda)		-3,12%	-4,00%	-4,07%	-7,81%	3,83%	-3,87%	10,77%	-0,95%	-0,18%	4,39%
Indicadores de desempenho B3	Ibovespa	4,97%	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%
	Ibovespa (US\$)	8,35%	11,44%	5,17%	15,05%	-13,42%	7,37%	-20,10%	5,69%	6,36%	-3,76%
	IGC-NM	-3,85%	4,24%	1,26%	7,04%	-11,63%	-0,17%	-12,33%	3,08%	5,16%	1,50%
	IDIV	9,21%	7,47%	-2,32%	10,00%	-5,19%	4,26%	-8,38%	1,98%	4,27%	-1,80%
	ICON	-13,48%	2,25%	-2,51%	5,74%	-14,19%	-3,02%	-14,29%	9,18%	6,66%	-1,18%
	SMLL	-8,06%	3,42%	-5,19%	8,81%	-8,36%	-1,82%	-16,33%	5,16%	10,90%	-1,84%
Indicadores de desempenho Global	MSCI World (US\$)	-26,40%	-5,34%	-2,58%	2,45%	-8,43%	-0,16%	-8,77%	7,86%	-4,33%	-9,47%
	MSCI ACWI (US\$)	-26,69%	-4,96%	-2,63%	1,86%	-8,14%	-0,13%	-8,58%	6,86%	-3,86%	-9,74%
	MSCI EM (US\$)	-28,91%	-1,93%	-3,00%	-2,58%	-5,75%	0,14%	-7,14%	-0,69%	0,03%	-11,90%
	Dow Jones (US\$)	-20,95%	-3,32%	-3,05%	1,82%	-4,91%	0,04%	-6,71%	6,73%	-4,06%	-8,84%
	S&P 500 (US\$)	-24,77%	-5,26%	-2,90%	3,32%	-8,80%	0,01%	-8,39%	9,11%	-4,24%	-9,34%
Índices ANBIMA	CDI	8,89%	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%
	IMA Geral	7,80%	0,21%	0,74%	1,57%	0,54%	0,92%	0,43%	0,47%	1,40%	1,26%
	IMA-B	6,12%	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%	1,48%
	IMA-B 5	7,07%	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%
	IMA-B 5+	5,10%	-1,61%	0,01%	3,56%	0,08%	1,16%	-1,10%	-1,84%	2,49%	2,39%
	IDkA (IPCA 2a)	6,94%	0,05%	1,26%	2,54%	1,51%	0,85%	0,47%	-0,17%	-0,36%	0,62%
	IDkA (IPCA 5a)	5,89%	-0,49%	0,30%	3,38%	0,58%	1,09%	0,21%	-0,79%	0,95%	0,57%
	IRF-M	6,96%	-0,08%	0,58%	0,84%	-0,12%	0,58%	0,37%	1,15%	2,05%	1,40%
	IRF-M 1	8,59%	0,63%	0,74%	0,89%	0,75%	0,95%	0,93%	1,05%	1,23%	1,11%
	IRF-M 1+	6,25%	-0,50%	0,48%	0,81%	-0,53%	0,39%	0,09%	1,20%	2,60%	1,58%
	IDkA Pré 1A	8,03%	0,49%	0,67%	0,89%	0,61%	0,80%	0,66%	1,12%	1,35%	1,20%
IDkA Pré 2A	6,92%	-0,24%	0,51%	0,85%	-0,17%	0,60%	0,28%	1,12%	2,13%	1,66%	
IDkA Pré 5A	3,56%	-1,68%	0,37%	0,83%	-2,34%	-0,53%	-1,08%	1,57%	4,76%	1,80%	
Índices IBGE	IPCA	4,09%	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%	0,67%	-0,68%	-0,36%	-0,29%
	Meta Atuarial (IPCA + 4,81% aa)	7,82%	0,83%	1,41%	2,02%	1,46%	0,86%	1,06%	-0,29%	0,03%	0,10%
	IGEPREV	4,91%	0,50%	0,17%	1,54%	-0,61%	0,79%	-0,97%	1,88%	1,31%	0,23%

Distribuição por modalidade - 01 a 09-2022



2.3. Relatório mensal de Investimentos

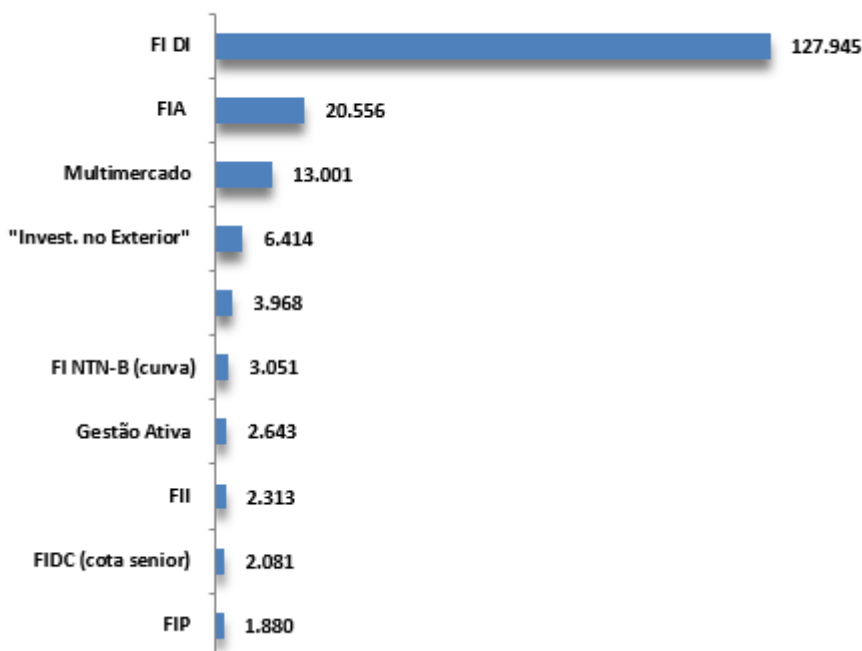
Resumo geral das alocações em R\$:

O Quadro-resumo em reais detalha as alocações do IGEPREV por enquadramento à Resolução, por classe e categoria de ativos, percentual aprovado na Política de Investimentos e permitido pela legislação, e valores identificados por Instituição Financeira no formato integral, por renda fixa, renda variável + estruturados + fundos imobiliários e investimentos no exterior.

Quadro-resumo de alocações, em R\$ por enquadramento e Instituição Financeira - 09/2022:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI - TPF			3.050.863,74		3.050.863,74				
			100%	100%	3.050.863,74	-	3.050.863,74	-	-	-	-
	art. 7º, III, a	FI DI			127.945.296,07	123.183.303,68	4.761.992,39				
		Gestão Ativa	60%	60%	2.643.383,43	575.441,40	2.067.942,03				
art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)		5%	5%	130.588.679,50	123.758.745,08	6.829.934,42				
					2.080.987,68			678.395,31	1.402.592,37		
TOTAL RF			100%	100%	135.720.530,92	123.758.745,08	9.880.798,16	678.395,31	1.402.592,37	-	-
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	20.555.664,83	18.343.043,97				2.212.620,86	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	13.001.069,26	13.001.069,26					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	1.879.655,39						1.879.655,39
	art. 11	FII	5%	5%	2.313.062,14						2.313.062,14
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	37.749.451,62	31.344.113,23				2.212.620,86	4.192.717,53
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"	10%	10%	6.413.884,75	262.609,92	6.151.274,83				
	art. 9º, III	Ações BDR Nível I			3.967.752,32	1.544.608,34	2.423.143,98				
TOTAL IE			10%	10%	10.381.637,07	1.807.218,26	8.574.418,81				
TOTAL GERAL			100%	100%	183.851.619,61	156.910.076,57	18.455.216,97	678.395,31	1.402.592,37	2.212.620,86	4.192.717,53

Distribuição por categoria (R\$ x 1000) - 09/2022



2.4. Relatório mensal de Investimentos

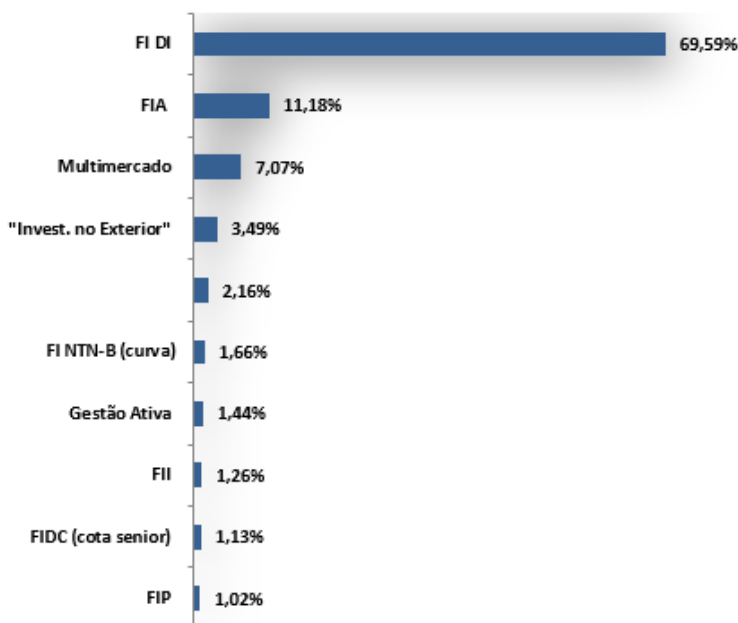
Resumo geral das alocações em %:

O Quadro-resumo em percentual detalha as alocações do IGEPREV por enquadramento à Resolução, por classe e categoria de ativos, percentual aprovado na Política de Investimentos e permitido pela legislação, e valores identificados por Instituição Financeira no formato integral, por renda fixa e por renda variável. Esta segregação é muito importante para observar o balanceamento da carteira do RPPS, identificando no caso do IGEPREV, uma elevada concentração em ativos vinculados ao CDI.

Quadro-resumo de alocações, em percentual por enquadramento e Instituição Financeira - 09/2022:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI - TPF			1,66%		1,66%				
			100%	100%	1,66%	0,00%	1,66%				
	art. 7º, III, a	FI DI			69,59%	67,00%	2,59%				
		Gestão Ativa			1,44%	0,31%	1,12%				
	60%	60%	71,03%	67,31%	3,71%						
art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	5%	5%	1,13%			0,37%	0,76%			
TOTAL RF			100%	100%	73,82%	67,31%	5,37%	0,37%	0,76%		
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	11,18%	9,98%				1,20%	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	7,07%	7,07%					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	1,02%						1,02%
	art. 11	FII	5%	5%	1,26%						1,26%
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	20,53%	17,05%				1,20%	1,26%
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"	10%	10%	3,49%	0,14%	3,35%				
	art. 9º, III	Ações BDR Nível I			2,16%	0,84%	1,32%				
TOTAL IE			10%	10%	5,65%	0,98%	4,66%				
TOTAL GERAL			100%	100%	100,00%	85,35%	10,04%	0,37%	0,76%	1,20%	1,26%

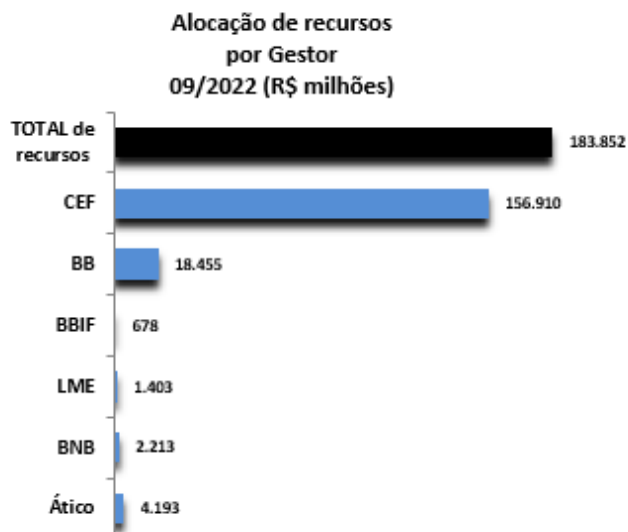
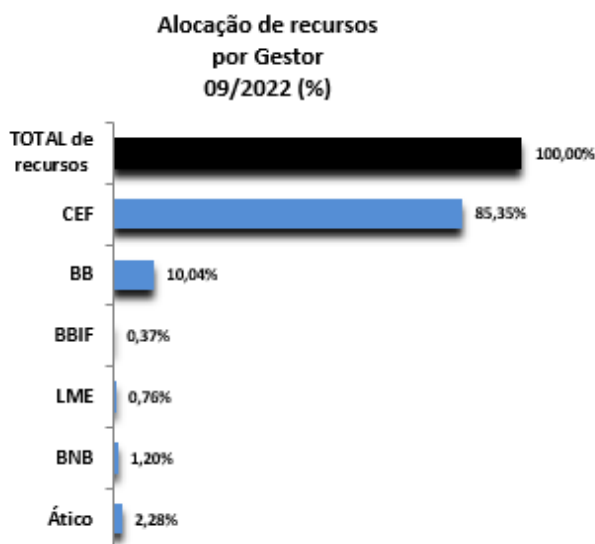
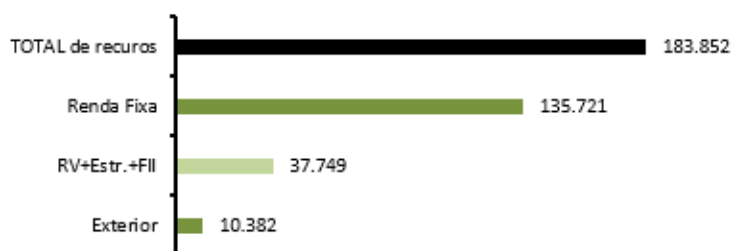
Distribuição por categoria (%) - 09/2022



2.5. Relatório mensal de Investimentos

Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante:

De forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV estão alocados.

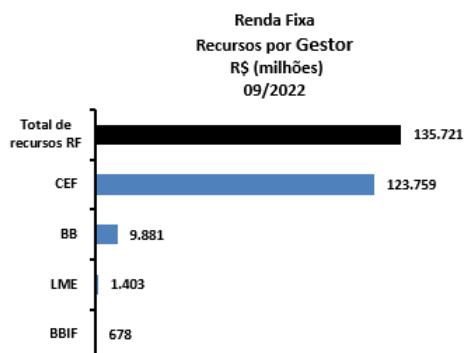
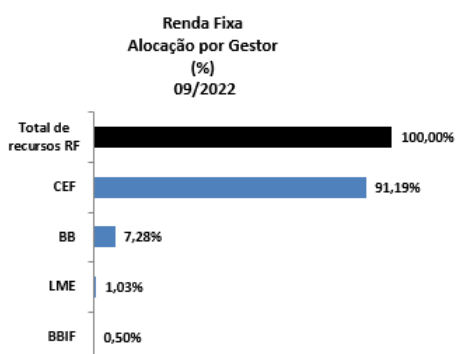


2.6. Relatório mensal de Investimentos

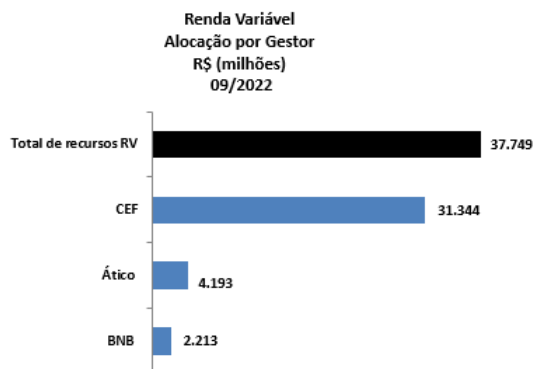
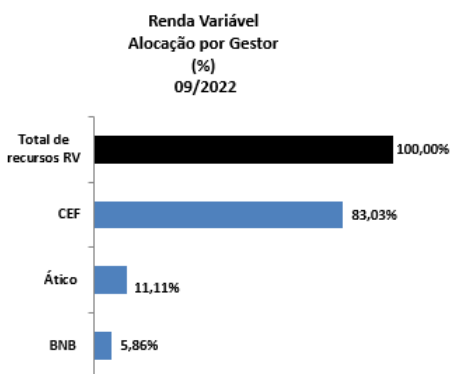
Alocação em Renda Fixa, Renda Variável e Investimento no Exterior:

Também de forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV, por classe de ativos, estão alocados.

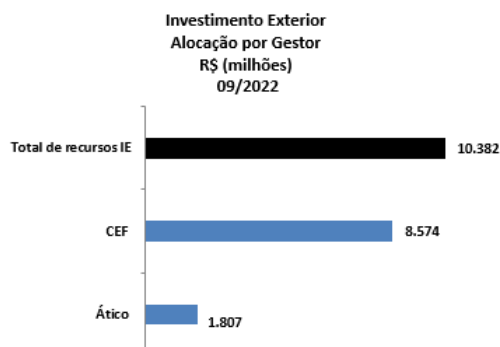
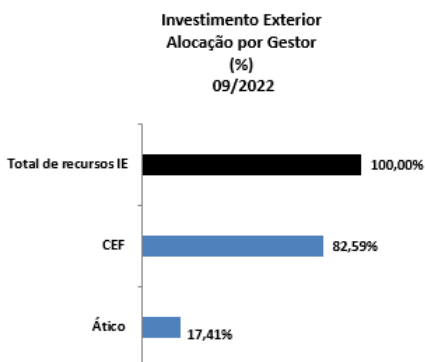
RENDA FIXA



RV + Estrut. + FI



INVESTIMENTO NO EXTERIOR



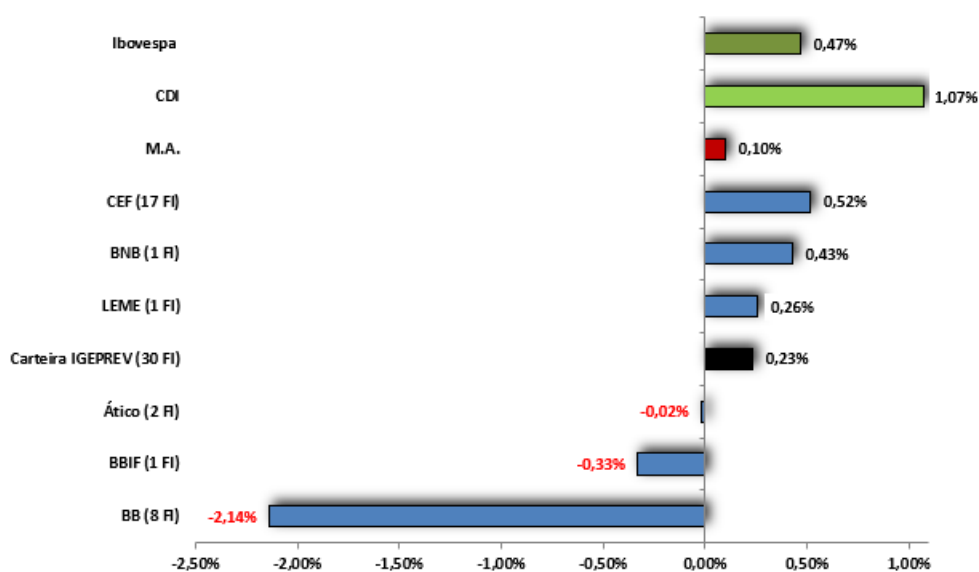
2.7. Relatório mensal de Investimentos

Extrato mensal do desempenho:

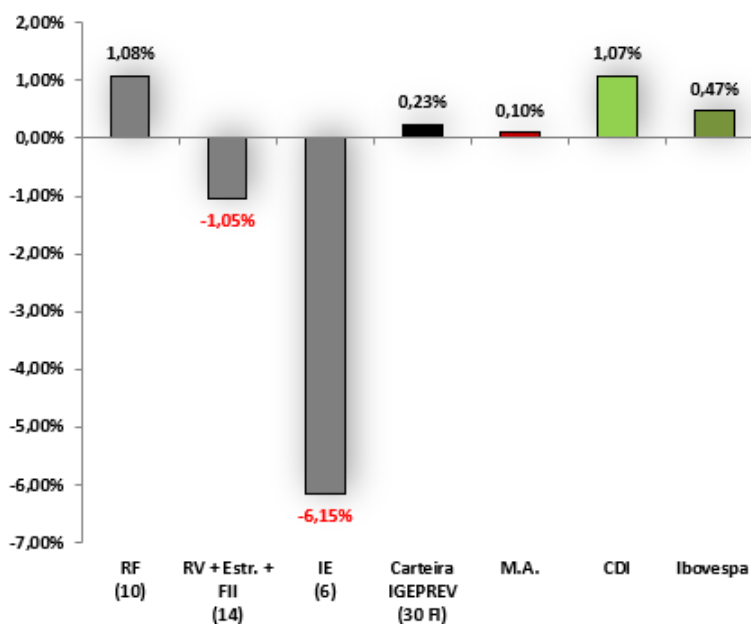
Os gráficos abaixo identificam o desempenho do IGEPREV por classe de ativos e por Instituição Financeira no mês em análise, em comparação com a meta atuarial e ao CDI.

Está identificado também a quantidade de fundos de investimentos em cada observação.

Rentabilidade por Gestores - 09/2022



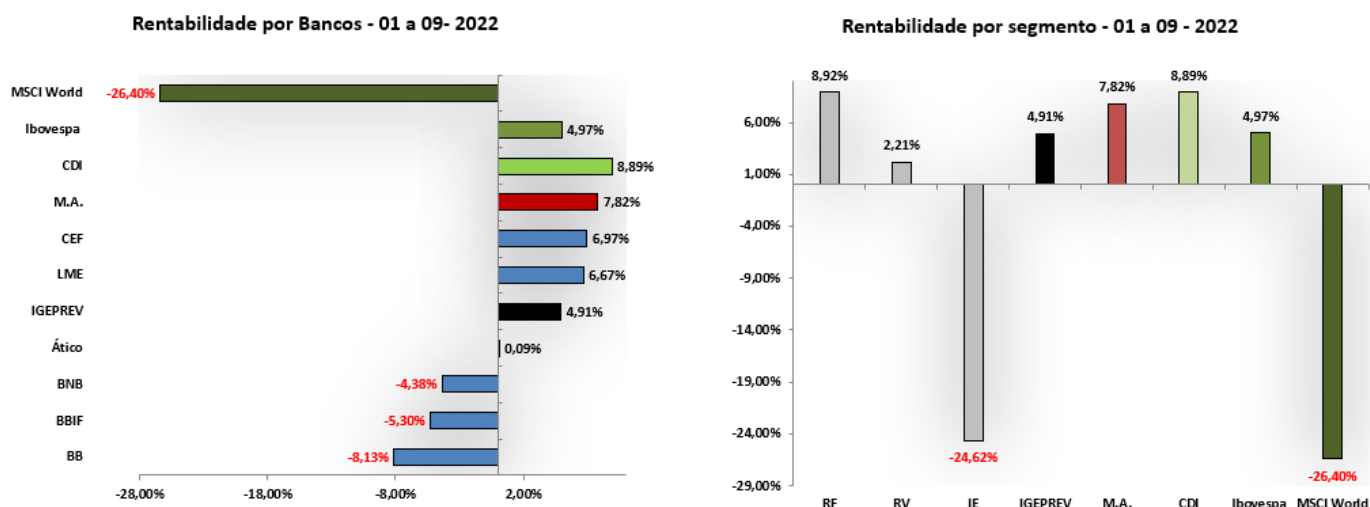
Rentabilidade por segmento - 09/2022



2.8. Relatório mensal de Investimentos

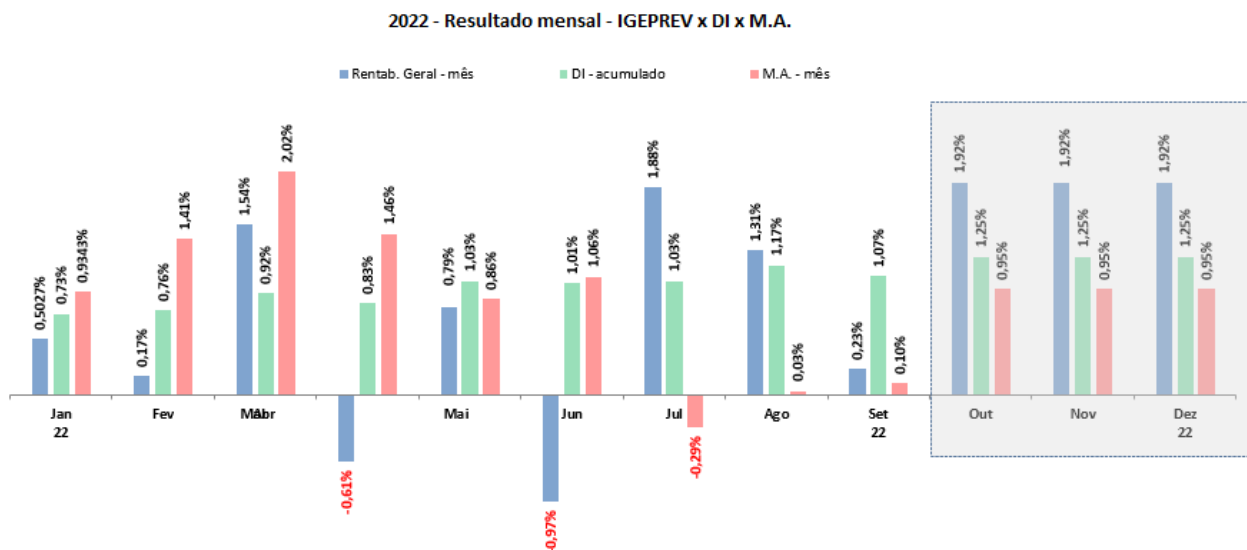
Rentabilidade Geral e Meta Atuarial – mensal, ano e estimada até dez:

O gráfico nº 01 indica de forma integral e por Instituição Financeira no exercício de 2022 a rentabilidade da carteira do IGEPREV e os desempenhos da meta atuarial e do CDI. Podemos verificar que em setembro o IGEPREV rentabilizou sua carteira em 4,91% (55% do CDI) contra uma meta atuarial de 7,82%, no acumulado anual.



O gráfico nº 02 registra essas variáveis (rentabilidade geral da carteira do IGEPREV, meta atuarial e CDI) no mês em análise e projeta de forma linear o que cada variável precisará em cada mês para chegar em dezembro/22 com a previsão destacada.

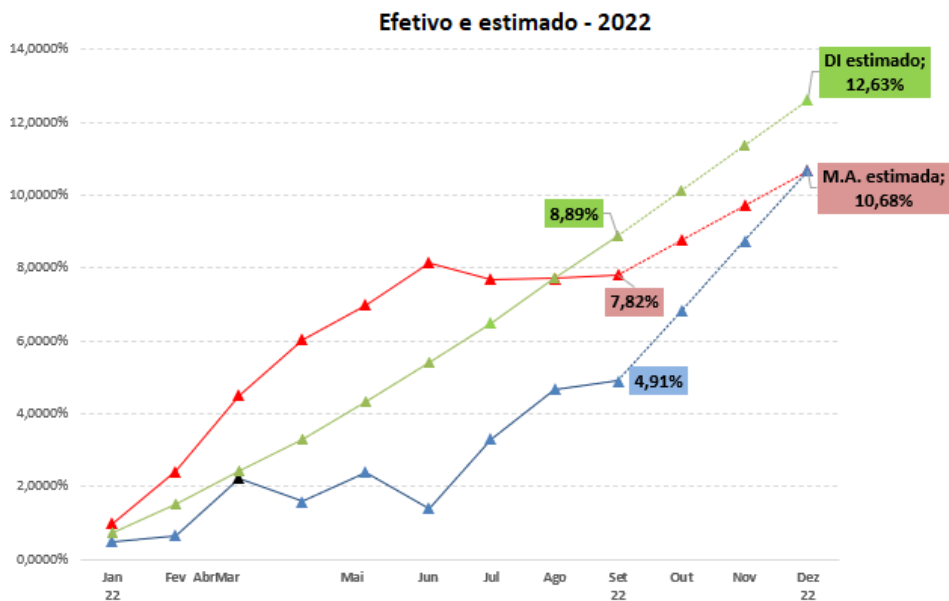
Gráfico nº 02



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

O gráfico nº 03 registra o momento do desempenho da carteira do IGEPREV em relação à meta atuarial e o CDI do acumulado no ano em análise e a projeção do exercício 2022.

Gráfico nº 03



2.9. – Relatório mensal de Investimentos

Riscos da carteira:

Nome	VaR Histórico	VaR 95,0% MV 21 du	VaR Condicional	Volatilidade	Tracking Error - CDI					
						no mês - diária				
						01/09/2022 até 30/09/2022				
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,92%	12,27%	2,98%	25,84%	25,84%					
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,92%	10,57%	2,59%	22,26%	22,26%					
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	1,12%	0,15%	2,36%	2,36%					
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	1,59%	9,17%	2,15%	19,32%	19,32%					
BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	1,99%	8,74%	2,10%	18,40%	18,40%					
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	-0,05%	0,02%	-0,05%	0,04%	0,04%					
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	0,00%	-0,05%	0,00%	0,00%					
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	1,45%	0,27%	3,05%	3,05%					
BBIF MASTER FIDC LP 1	0,02%	0,00%	0,02%	0,01%	0,01%					
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	1,53%	8,47%	1,72%	17,84%	17,84%					
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,05%	10,03%	2,32%	21,13%	21,13%					
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,19%	1,55%	0,29%	3,26%	3,26%					
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,75%	8,81%	2,22%	18,56%	18,56%					
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,13%	1,00%	0,14%	2,11%	2,11%					
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	-0,04%	0,00%	-0,04%	0,00%	0,00%					
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,06%	1,41%	0,14%	2,97%	2,97%					
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	-0,05%	0,03%	-0,05%	0,06%	0,06%					
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1,83%	10,35%	2,19%	21,80%	21,80%					
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,05%	0,02%	-0,05%	0,04%	0,04%					
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	0,14%	1,45%	0,25%	3,06%	3,06%					
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1,80%	9,68%	2,09%	20,39%	20,39%					
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2,13%	11,13%	2,34%	23,44%	23,44%					
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,79%	11,70%	2,76%	24,65%	24,65%					
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,74%	9,55%	2,19%	20,12%	20,12%					
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	1,51%	7,87%	1,67%	16,58%	16,58%					
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2,52%	12,05%	2,84%	25,39%	25,39%					
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-0,01%	0,19%	0,03%	0,39%	0,39%					

3. Carteiras sugeridas CEF e BB:

Mensalmente CEF e BB enviam aos RPPS uma carteira sugerida com posições relativas a seus produtos adequados à Resolução. Desta forma, adotamos essas sugestões como uma referência na análise do desempenho da carteira do IGEPREV.

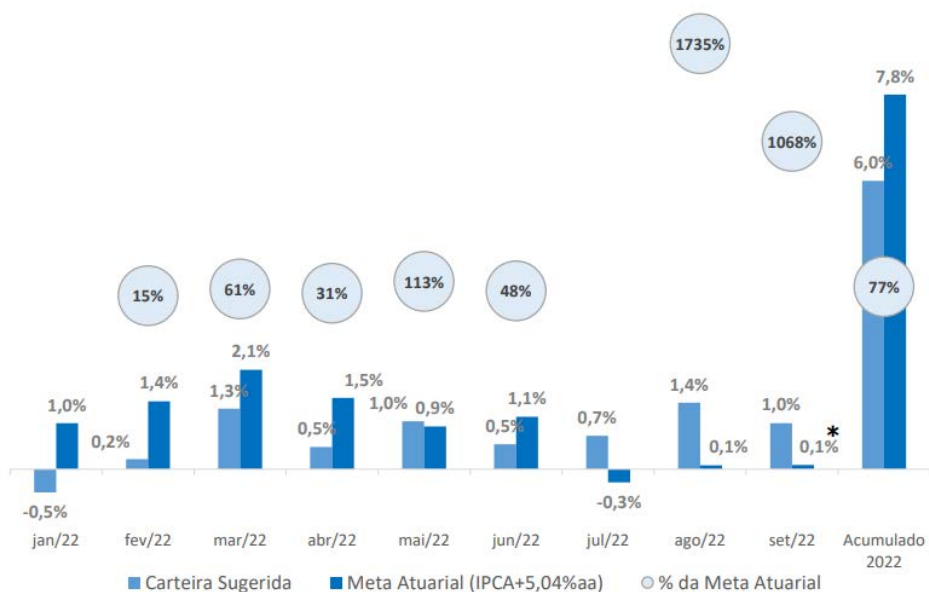
O efeito comparativo aqui apresentado, possui o único objetivo de demonstrar que as alocações dos recursos do RPPS encontram-se em sintonia com as melhores práticas de gestão financeira do mercado para este segmento, considerando que a performance geral da autarquia superou as opções sugeridas em ambas as Instituições.

Fundo	Benchmark	Limite 4.963	Carteira	
			Mês anterior	Mês atual
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IMA-B 5	100%	2%	2%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	CDI	100%	4%	0%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IRF-M	100%	2%	5%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IRF-M 1+	100%	1%	6%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	IPCA	100%	8%	3%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IDKA IPCA 2A	100%	1%	0%
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CDI	100%	19%	16%
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	CDI	60%	17%	19%
CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF	CDI	60%	20%	20%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	IPCA	60%	11%	11%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	IPCA+6%	5%	1%	0%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	IBOV	30%	2%	3%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	IBOV	30%	1%	1%
CAIXA EXPERT CLARITAS VALOR FIC AÇÕES	IBOV	30%	0%	2%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	IBOV	30%	0%	1%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	CDI	10%	10%	8%
CAIXA FIC BRASIL ESTRATEGIA LIVRE MULTIMERCADO	CDI	10%	0%	2%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	BDR	10%	1%	1%

▲ Aumento ■ Manutenção ▼ Redução

Acesse o portfólio completo de fundos da CAIXA clicando [aqui](#).

Retorno da Carteira Sugerida



*Meta Atuarial com IPCA projetado para Setembro – Fonte: [ANBIMA](#)



Carteira Sugerida

SETEMBRO/2022

As sugestões de aplicações em fundos de investimento a seguir apresentadas estão fundamentadas em uma metodologia própria, onde as alternativas de investimento encontram-se adequadas à legislação vigente - Resolução CMN nº 4.963/21. A partir deste modelo, são propostas 03 (três) sugestões com diferentes perfis de investimento, cabendo ao cliente realizar a escolha que melhor se adeque ao seu perfil de risco ou outra composição que julgue mais aderente à sua política de investimentos. As informações disponibilizadas no presente documento são públicas, podendo ser repassadas pelos funcionários do Banco do Brasil aos Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS.

		CARTEIRA SUGERIDA		
		CONSERVADOR	MODERADO	ARROJADO
R E N D A F I X A	RENTA FIXA	<p>41% PERFIL FIC DI ATIVA - RETORNO TOTAL ALOCAÇÃO ATIVA - PREVIDENCIÁRIO</p> <p>50% IDKA 2 TP FI IMA-B 5 FIC IMA-B TP FI IMA-B 5+ TP FI IRF-M1 TP FIC</p>	<p>39% PERFIL FIC DI ATIVA - RETORNO TOTAL ALOCAÇÃO ATIVA - PREVIDENCIÁRIO</p> <p>40% IDKA 2 TP FI IMA-B 5 FIC IMA-B TP FI IMA-B 5+ TP FI IRF-M1 TP FIC</p>	<p>32% PERFIL FIC DI ATIVA - RETORNO TOTAL ALOCAÇÃO ATIVA - PREVIDENCIÁRIO</p> <p>34% IDKA 2 TP FI IMA-B 5 FIC IMA-B TP FI IMA-B 5+ TP FI IRF-M1 TP FIC</p>
	V A R I Á V E L	<p>4% MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP PREVIDENCIÁRIO ALOCAÇÃO JUROS E MOEDAS</p> <p>4% AÇÕES QUANTITATIVO MIDCAPS AÇÕES AGRO</p> <p>1% INVESTIMENTO NO EXTERIOR BDR NÍVEL I</p>	<p>7% MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP PREVIDENCIÁRIO ALOCAÇÃO JUROS E MOEDAS</p> <p>10% AÇÕES QUANTITATIVO MIDCAPS AÇÕES AGRO GOVERNANÇA</p> <p>4% INVESTIMENTO NO EXTERIOR ALOCAÇÃO ETF EXTERIOR BDR NÍVEL I NORDEA INVESTIMENTO</p>	<p>10% MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP PREVIDENCIÁRIO ALOCAÇÃO JUROS E MOEDAS</p> <p>17% AÇÕES QUANTITATIVO MIDCAPS AÇÕES AGRO GOVERNANÇA</p> <p>7% INVESTIMENTO NO EXTERIOR ALOCAÇÃO ETF EXTERIOR BDR NÍVEL I BOLSAS GLOBAIS ETF NORDEA INVESTIMENTO</p>

2022	Setembro	Ano
------	----------	-----

BB não informado

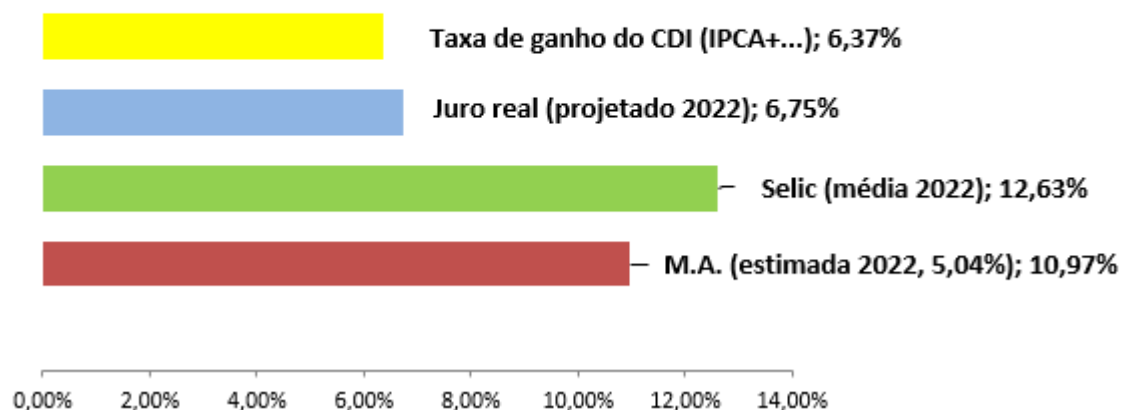
CEF 1,00% 6,00%

IGEPREV -0,30% 4,79%

4. Cenário 2022 e 2023 (Juros reais x CDI x M.A.):

Atualmente, as projeções expostas pela Gerin – Gerência Executiva de Relacionamento com Investidores do BACEN, em seu “*Relatório de Mercado – FOCUS*”, de 26/09/2022, revela uma expectativa de inflação – **IPCA** – para 2022 de **5,88 %**, com tendência de queda, e **Taxa SELIC** a **13,75%** até o final do ano, com média de **12,63%**. Sendo assim, mediante essas projeções, nossa **Meta Atuarial** do ano fica redefinida neste mês em **10,97%** para o exercício de 2022, ou seja, **87%** do CDI.

Projeção Focus 2022 - semana 26/09/22

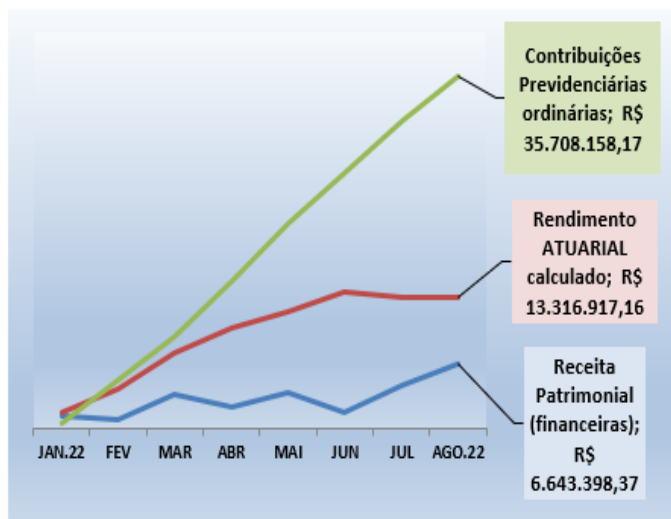


5. Cronograma mensal de Atividades de Gestão de Recursos

Preencher Grade de Investimentos do mês encerrado com base nos extratos;	executado
Calcular rentabilidade mensal da carteira;	executado
Calcular meta atuarial mensal da carteira;	executado
Calcular a rentabilidade anual da carteira;	executado
Calcular meta atuarial anual da carteira;	executado
Calcular a rentabilidade dos últimos 12 meses da carteira;	executado
Calcular meta atuarial dos últimos 12 meses da carteira;	executado
Colher os indicadores de desempenho global, B3, ANBIMA e IBGE (mês, ano e 12 meses);	executado
Efetuar se necessário o rebalanceamento da carteira;	executado
Reunião com o Comitê de Investimentos;	executado
Preencher e enviar o DAIR;	executado
Preencher o Relatório Mensal dos investimentos;	executado
Preencher a planilha de Resultado Atuarial x Resultado Financeiro;	executado
Preencher a planilha BACEN - IPCA x Selic (cenário/perspectiva quatro exercícios);	executado
Calcular Selic média	executado
Preencher a planilha de Distribuição;	executado
Preencher a planilha das taxas dos TP;	executado
Preencher a planilha de análise mensal de Risco x Retorno;	executado
Preencher a planilha de análise mensal de Correlação;	executado
Preencher a planilha de Valorização IMA, com eventos diários (conjuntura).	executado
Monitorar cotas médias dos fundos	executado
Acompanhamento e monitoramento contínuo dos riscos dos recursos investidos;	executado
Cumprimento dos indicadores definidos por segmento de alocação e produto;	executado
Análise diária do comportamento do mercado (eventos diários, conjuntura);	executado
Análise diária da performance de produtos e de instituições gestoras de carteiras.	executado

6.1. Relatório de Compatibilidade do P com A (ALM) Comparativo Receita Financeira x Receita Atuarial Estimada:

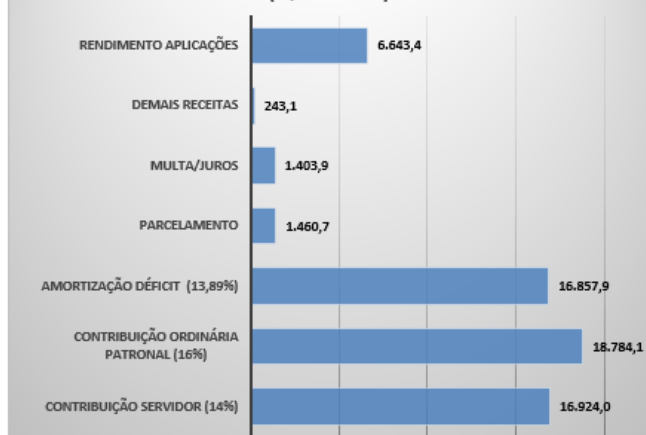
2022 - Evolução das Receitas



Quadro-resumo: Análise do Desempenho

	R\$ (milhares)
PL em 31/12/21	174.082,5
PL em 31/08/22	181.363,7
Evolução do PL (c/ despesas pagas)	7.281,2
Contribuições Previdenciárias do Ente	38.506,5
Contribuição Previdenciária do Servidor	16.924,0
Demais receitas	243,1
Rendimento de Aplicação Financeira	6.643,4
Rendimento Atuarial programado	13.423,9
Insuficiência financeira sobre a meta atuarial	- 6.780,5

Segmentação das fontes de recursos - 01 a 08.2022 (R\$ milhares)

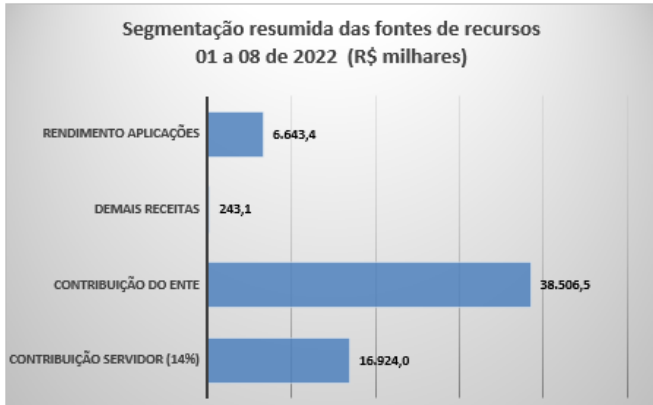


Fontes de recursos (jan/ago - 2022)

Fonte de Recursos	R\$ (milhares)
Pagamentos	57.317,3
Contribuição servidor (14%)	16.924,0
Contribuição ordinária patronal (16%)	18.784,1
Amortização Déficit (13,89%)	16.857,9
Parcelamento	1.460,7
Multa/Juros	1.403,9
Demais Receitas	243,1
Rendimento aplicações	6.643,4
Evolução do PL	7.281,2
Meta atuarial	13.423,9

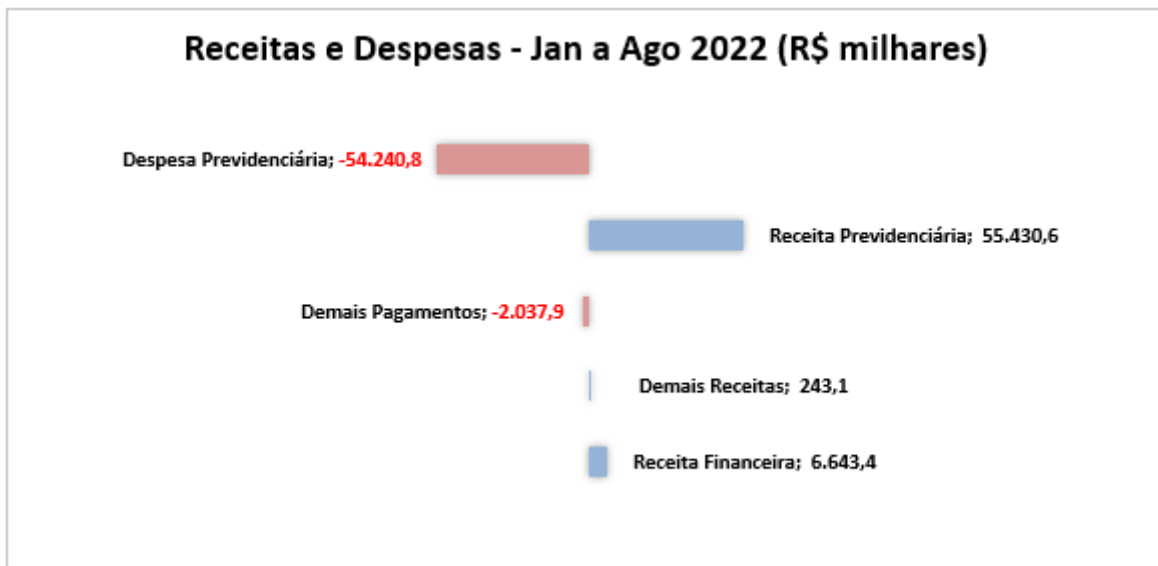
11% dos recursos recebidos (aplicação para Rendimento aplicações)

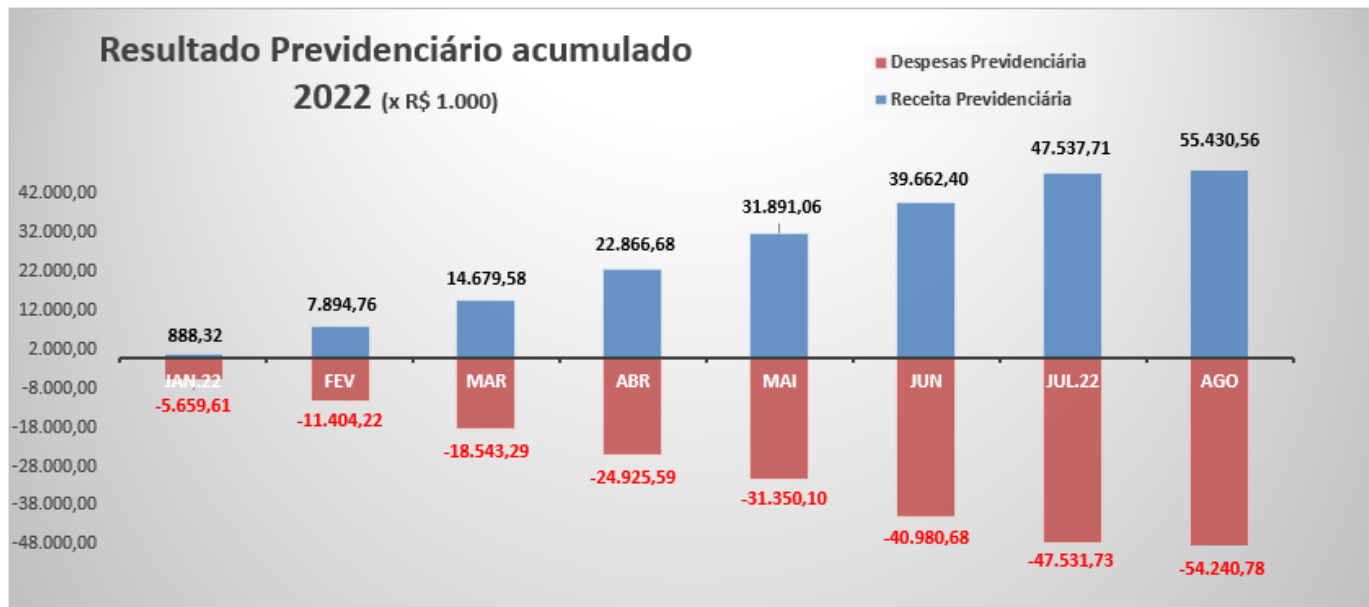
19% dos recursos recebidos (aplicação para Meta atuarial)



Fontes de recursos (jan/ago - 2022)	R\$ (milhares)
Pagamentos	57.317,3
Contribuição servidor (14%)	16.924,0
Contribuição do Ente	38.506,5
Demas Receitas	243,1
Rendimento aplicações	6.643,4
Evolução anual do PL	7.281,18
Meta atuarial	13.423,9

90% dos recursos recebidos

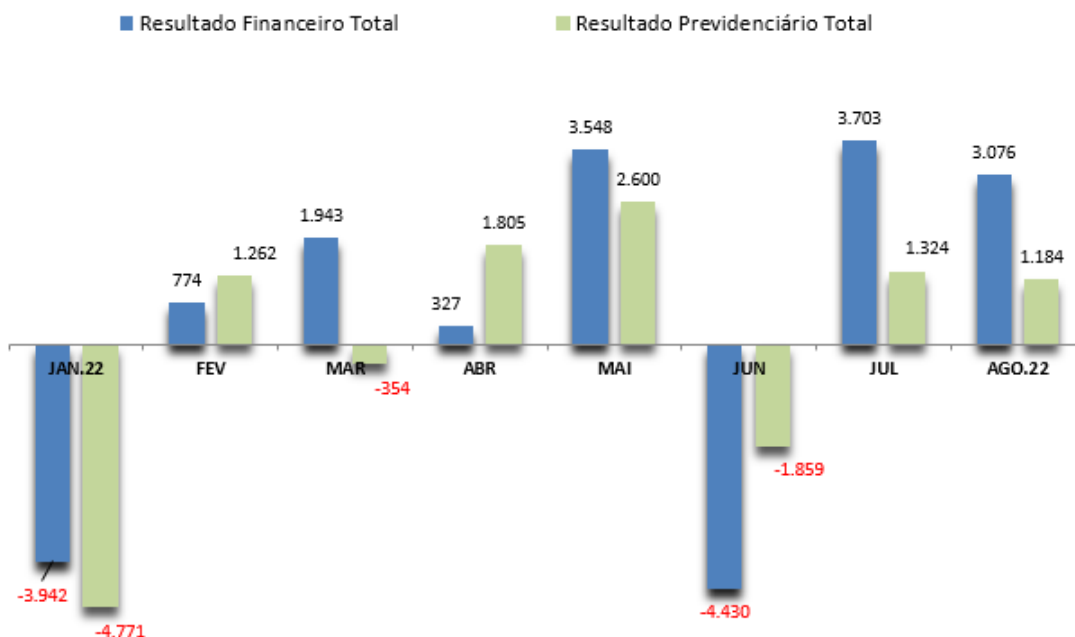




Foi analisado os resultados mensais financeiros e previdenciários. O resultado financeiro agrega as receitas da contribuição previdenciária do servidor e do ente, mais as receitas com a amortização do déficit os parcelamentos de débitos previdenciários, multa e juros sobre contribuições, demais receitas e as receitas das aplicações financeiras, descontado os pagamentos integrais do RPPS efetuados no mês.

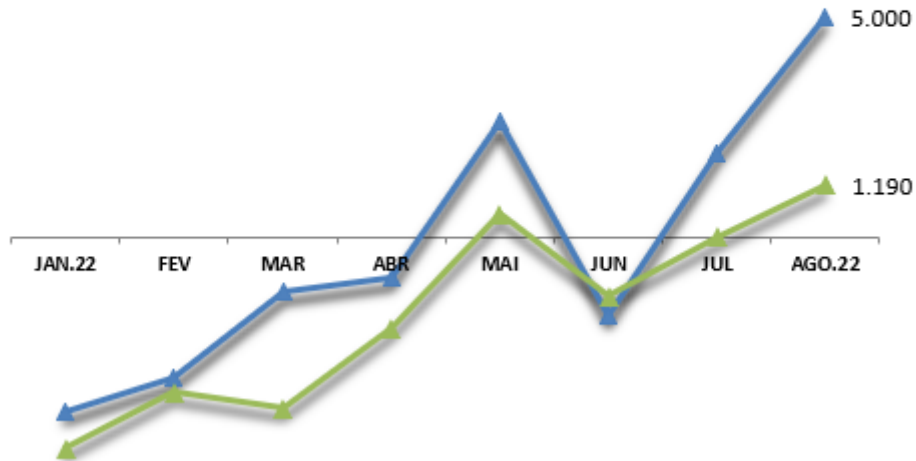
O resultado previdenciário considera apenas as receitas da contribuição previdenciária do servidor e do ente, mais as receitas com a amortização do déficit os parcelamentos de débitos previdenciários, multa e juros sobre contribuições, descontado os pagamentos dos benefícios previdenciários efetuados no mês.

2022 - Resultado líquido mensal (R\$ milhares)

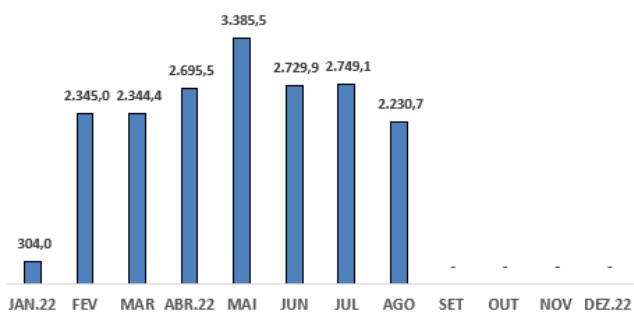


2022- Resultado acumulado mensal (R\$ milhares)

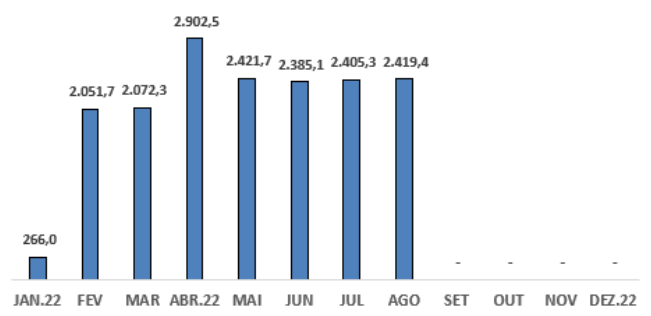
Resultado Financeiro Total Resultado Previdenciário Total



Repasse alíquota Patronal - 2022 (R\$ milhares)



Repasse Servidor - 2022 (R\$ milhares)






7.1. Relatório semestral de Diligências

Verificação dos Ativos que compõem o PL dos FI's e TVM, excluídos TPF:

- Caixa Bolsa Americana FIM LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02):

Composição da Carteira




	Nome do Ativo		Valor do Ativo (R\$)		Participação do Ativo
	NTN-B - Venc.: 15/05/2023		857.381,14		17,3722 %
	NTN-B - Venc.: 15/08/2022		804.744,47		16,3057 %
	NTN-B - Venc.: 15/08/2024		510.402,13		10,3417 %
	NTN-B - Venc.: 15/05/2025		437.067,06		8,8558 %
	NTN-B - Venc.: 15/05/2021		350.886,60		7,1096 %
	LFT - Venc.: 01/03/2026		269.009,35		5,4506 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024		224.153,28		4,5418 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2023		222.368,92		4,5056 %
	VALE ON N1 - VALE3		104.149,67		2,1103 %
	LFT - Venc.: 01/09/2025		97.419,13		1,9739 %
	LFT - Venc.: 01/09/2026		85.142,66		1,7252 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2021		70.490,16		1,4283 %
	ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4		36.212,92		0,7337 %
	LFT - Venc.: 01/03/2024		33.969,35		0,6883 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2022		33.441,67		0,6776 %
	AMBEV S/A ON - ABEV3		33.068,06		0,6700 %
	MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3		32.918,12		0,6670 %
	PETROBRAS PN - PETR4		31.775,95		0,6438 %
	B3 ON NM - B3SA3		30.399,53		0,6160 %
	BRADESCO PN N1 - BBDC4		28.340,12		0,5742 %
	PETROBRAS ON - PETR3		23.697,62		0,4802 %
	INTERMEDICA ON NM - GNDI3		22.186,10		0,4495 %
	GRUPO NATURAON NM - NTCO3		21.383,47		0,4333 %
	LFT - Venc.: 01/03/2023		21.268,68		0,4309 %
	JBS ON NM - JBSS3		20.336,31		0,4121 %
	LOCALIZA ON NM - RENT3		19.379,91		0,3927 %
	LOJAS RENNER ON NM - LREN3		16.580,78		0,3360 %
	WEG ON NM - WEGE3		15.167,56		0,3073 %
	LFT - Venc.: 01/09/2024		14.045,75		0,2846 %
	VIAVAREJO ON N2 - VVAR3		13.484,53		0,2732 %
	BRASIL ON NM - BBAS3		13.467,88		0,2729 %
	RAIADROGASIL ON NM - RADL3		13.044,75		0,2643 %
	SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3		12.807,74		0,2595 %
	ITAUSA PN N1 - ITSA4		11.945,15		0,2420 %
	LOJAS AMERIC PN - LAME4		10.572,47		0,2142 %
	CYRELA REALT ON NM - CYRE3		9.984,80		0,2023 %
	LFT - Venc.: 01/03/2025		9.811,81		0,1988 %
	PETRORIO ON NM - PRIO3		9.147,21		0,1853 %
	ENEVA ON NM - ENEV3		8.908,13		0,1805 %
	GERDAU PN N1 - GGBR4		8.871,52		0,1798 %
	AZUL PN N2 - AZUL4		8.808,02		0,1785 %
	BRF SA ON NM - BRFS3		8.798,29		0,1783 %
	BTGP BANCO UNT - BPAC11		8.214,48		0,1664 %
	B2W DIGITAL ON NM - BTOW3		8.172,01		0,1656 %
	COGNA ON ON NM - COGN3		8.058,65		0,1633 %
	LOCAMERICA ON NM - LCAM3		7.409,46		0,1501 %
	MARFRIG ON NM - MRFG3		7.361,64		0,1492 %
	RUMO S.A. ON NM - RAIL3		7.292,15		0,1478 %
	QUALICORP ON NM - QUAL3		7.174,41		0,1454 %
	BANCO INTER UNT N2 - BIDI11		7.096,58		0,1438 %
	IRBRASIL RE ON NM - IRBR3		6.969,66		0,1412 %

• Caixa Brasil Estratégia Livre FIC FIM LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18):

CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE FI MULTIMERCADO LP

CNPJ: 34.660.200/0001-92

Composição da Carteira

 Ativo		Valor do Ativo (R\$)	 Participação do Ativo
LFT - Venc.: 01/03/2026		258.227,97	29,6652 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022		255.607,46	29,3642 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2021		131.657,27	15,1248 %
LFT - Venc.: 01/03/2024		54.991,09	6,3174 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023		32.613,90	3,7467 %
LFT - Venc.: 01/09/2026		31.576,42	3,6275 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024		25.282,91	2,9045 %
LFT - Venc.: 01/09/2023		21.387,07	2,4569 %
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11		17.512,47	2,0118 %
LFT - Venc.: 01/03/2021		10.740,80	1,2339 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021		9.231,10	1,0605 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2025		8.662,36	0,9951 %
Opções - Posições titulares - IBOVL98		4.777,50	0,5488 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3		3.927,84	0,4512 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3		3.372,50	0,3874 %
CENTAURO ON NM - CNTO3		2.470,08	0,2838 %
LOJAS AMERIC PN - LAME4		2.109,56	0,2423 %
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER - DI1 X PRE		1.670,16	0,1919 %
Opções - Posições titulares - IBOVL102		1.656,57	0,1903 %
B2W DIGITAL ON NM - BTOW3		1.654,40	0,1901 %
Opções - Posições titulares - IBOVA106		614,67	0,0706 %
Opções - Posições titulares - IBOVL310		611,10	0,0702 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF29		247,52	0,0284 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DOLFUTF21		81,73	0,0094 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF22		48,31	0,0055 %
Opções - Posições titulares - IBOVX89		43,20	0,0050 %
Mercado Futuro - Posições compradas - SEKFUTG21		34,00	0,0039 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24		26,18	0,0030 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - T10FUTH21		7,00	0,0008 %
Outros Valores a receber		5,53	0,0006 %
Outras Disponibilidades		0,93	0,0001 %
Opções - Posições titulares - DOLOPDZND8		0,00	0,0000 %
Opções - Posições lançadas - DOLOPDZND3		0,00	0,0000 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL140		0,00	0,0000 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN21		-12,27	-0,0014 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - NOKFUTG21		-21,00	-0,0024 %
Outros Valores a pagar		-31,06	-0,0036 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL113		-243,18	-0,0279 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL11		-341,46	-0,0392 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL5		-571,27	-0,0656 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL108		-648,48	-0,0745 %
Opções - Posições lançadas - IBOVA110		-704,13	-0,0809 %
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR - DI1 X PRE		-1.074,67	-0,1235 %

7.2. Relatório semestral de Diligências

Situação patrimonial, fiscal, comercial das empresas investidas em FIP:

- Dados conferidos nos relatórios de Dual Diligence:
 - <https://www.caixa.gov.br/site/paginas/downloads.aspx>

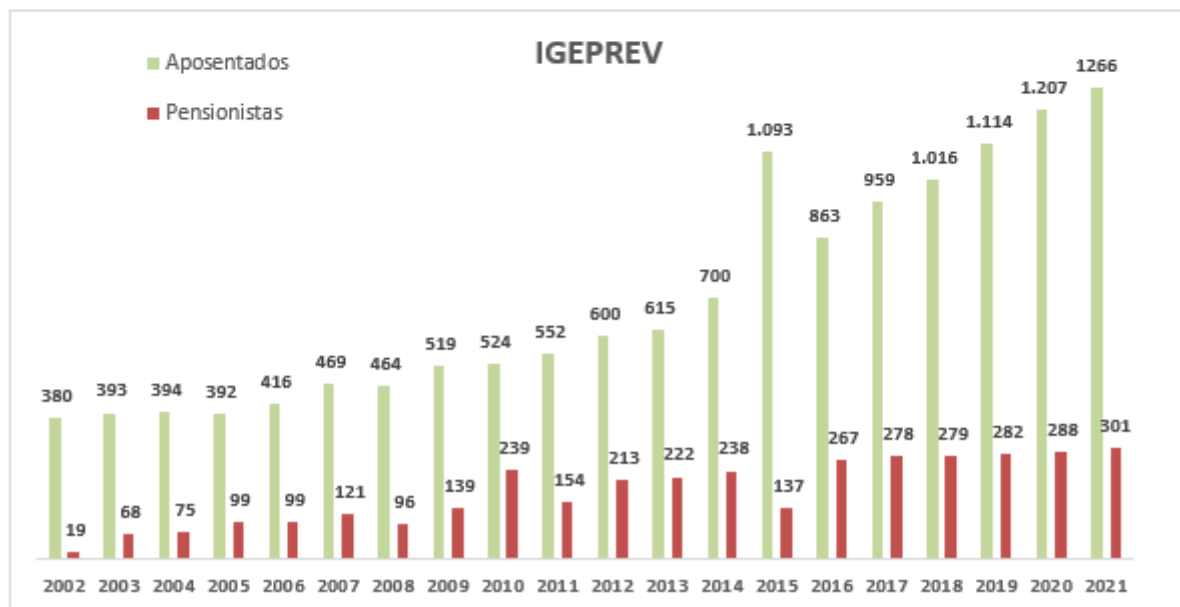
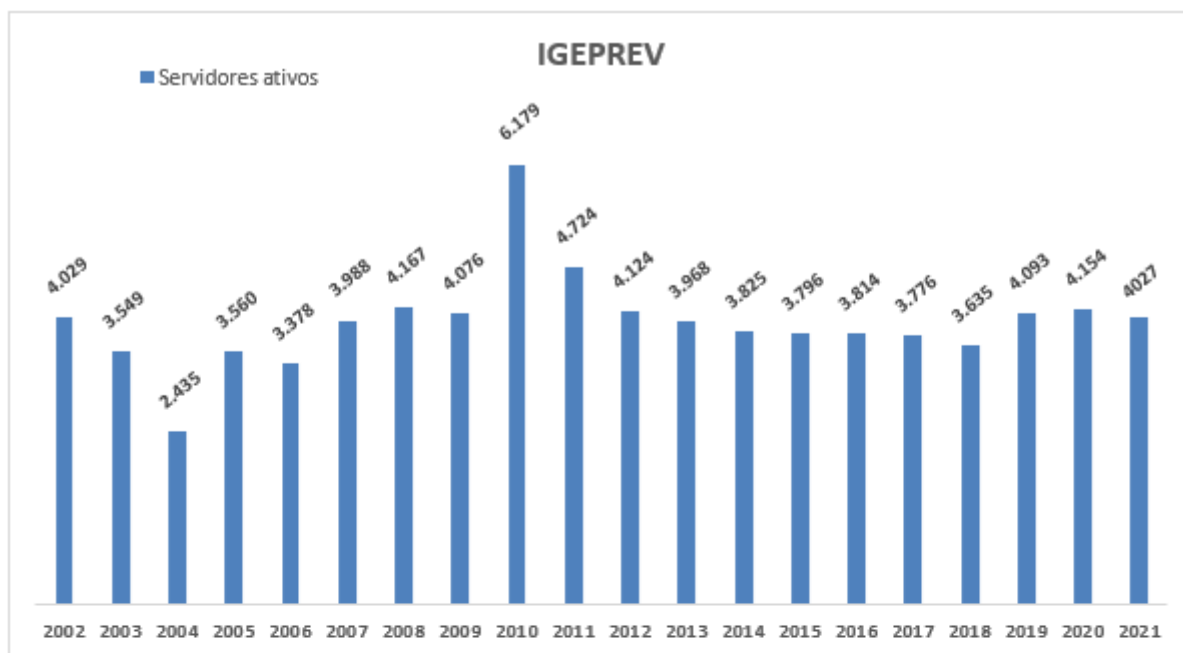
7.3. Relatório semestral de Diligências

Rating da RF: (FI, Ativos diretos, FIDC, Crédito Privado e Debêntures de Infra.):

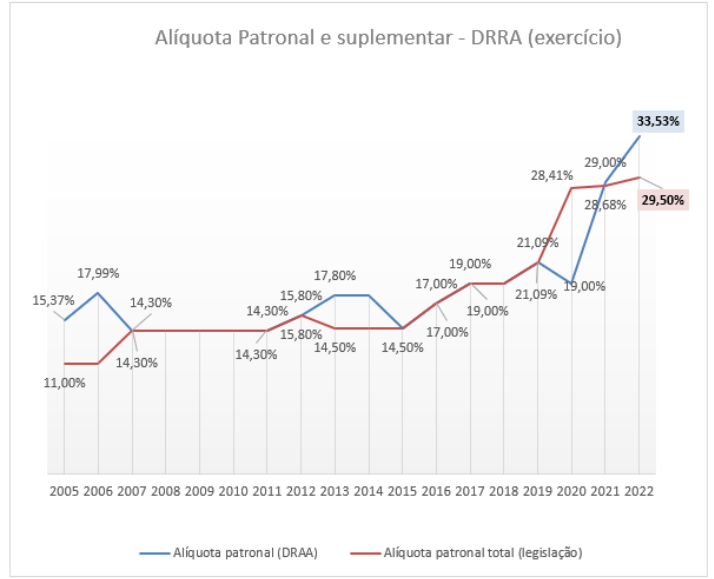
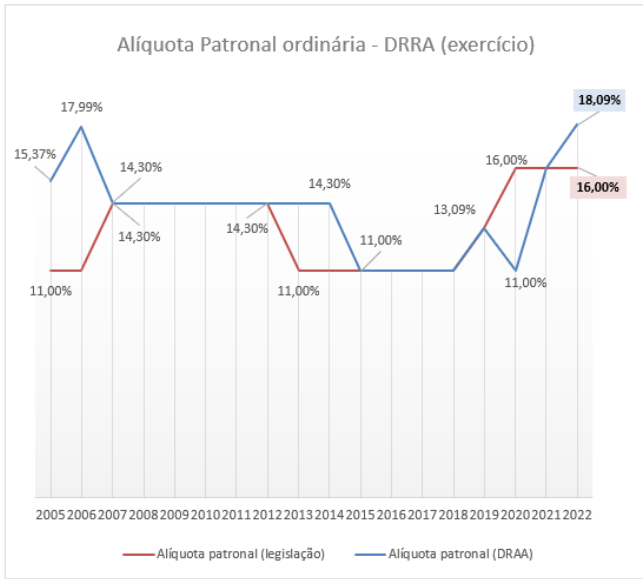
Nome	Risco Anbima
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	Renda Variável + Alavancagem
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	Renda Variável + Alavancagem
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Não informado
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	Não informado
BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	Não informado
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	Não informado
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Não informado
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Índice de Referência + Juros Mercado Doméstico + Crédito + Índice de Preços Mercado Doméstico + Alavancagem
BBIF MASTER FIDC LP 1	Não classificado
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	Não informado
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não classificado
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	Diversas Classes de Ativos + Alavancagem
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	Não informado
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	Não informado
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	Não informado
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Não informado
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	Não informado
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Não informado
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	Diversas Classes de Ativos
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	Renda Variável
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Não informado
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	Não informado
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	Renda Variável
HAZ FII - ATCR11	Não classificado
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não classificado

8.1. Relatório de Governança Corporativa

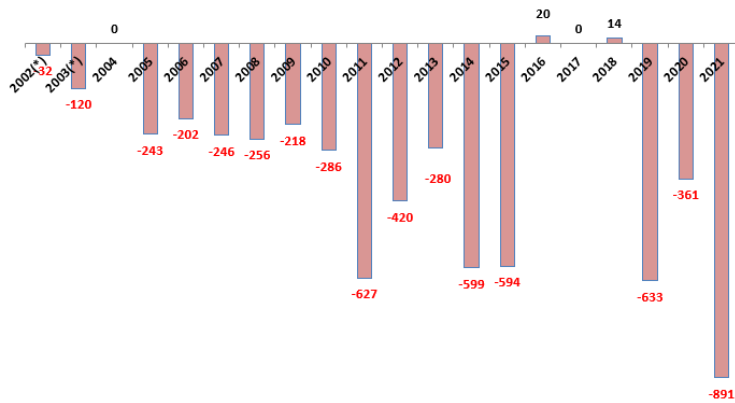
Evolução da situação atuarial:



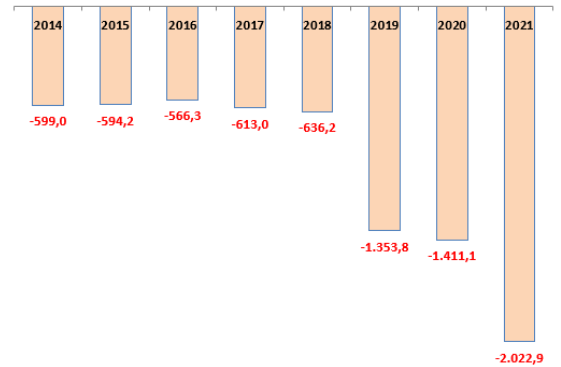
Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.



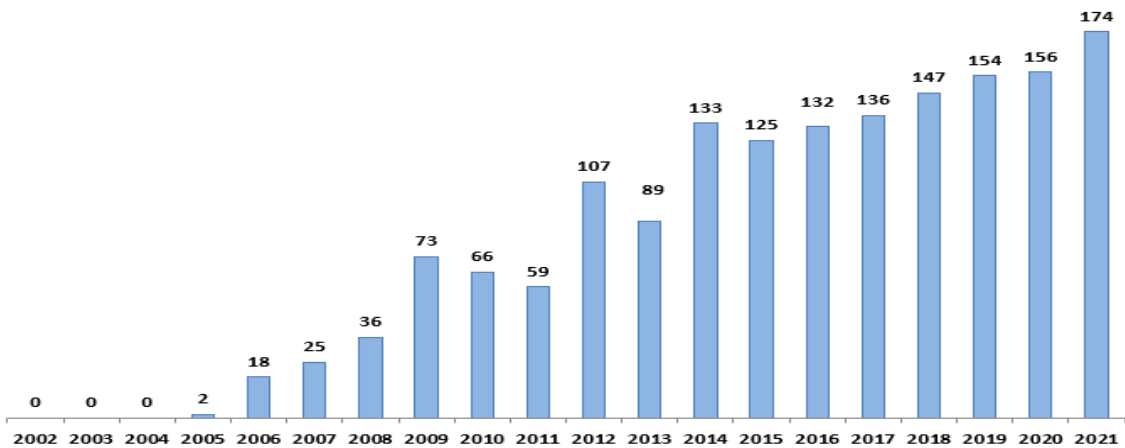
(Déficit)/Superávit Atuarial do Exercício - DRRA (competência) R\$ (milhões)

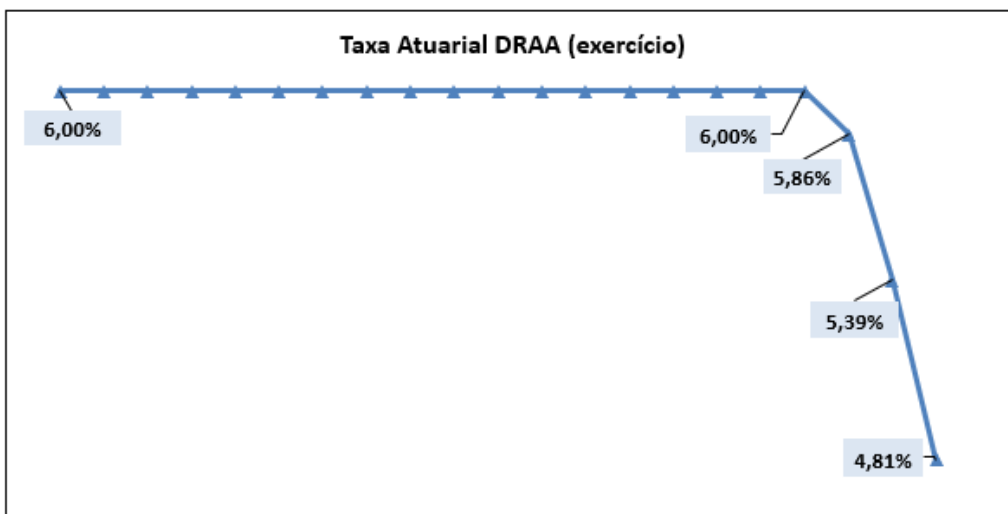


(Déficit)/Superávit Atuarial a Amortizar - DRRA (competência) R\$ (milhões)

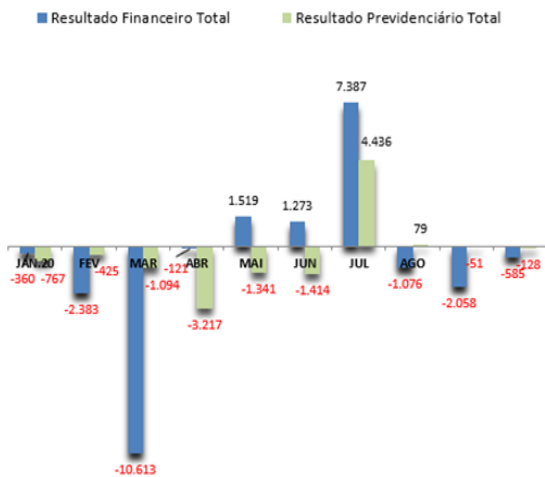


Aplicações Financeiras DRRA (competência) R\$ (milhões)

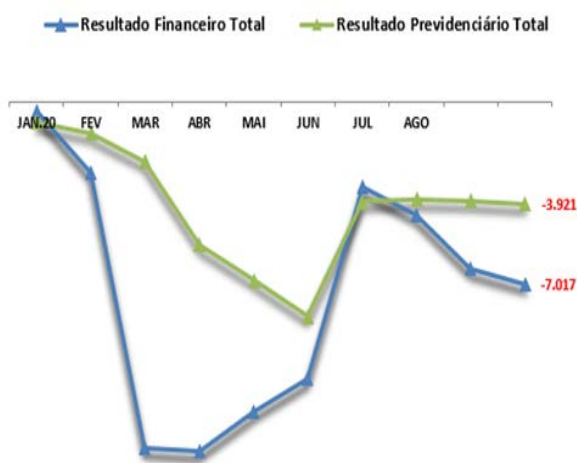




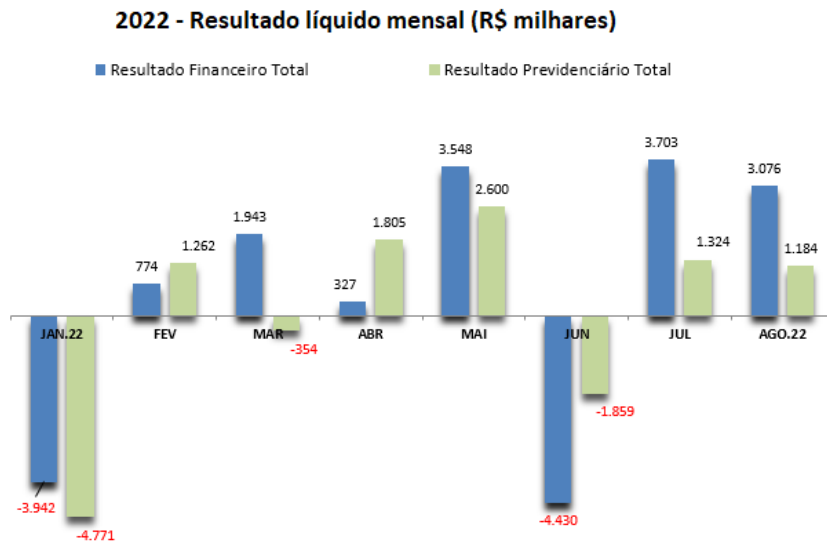
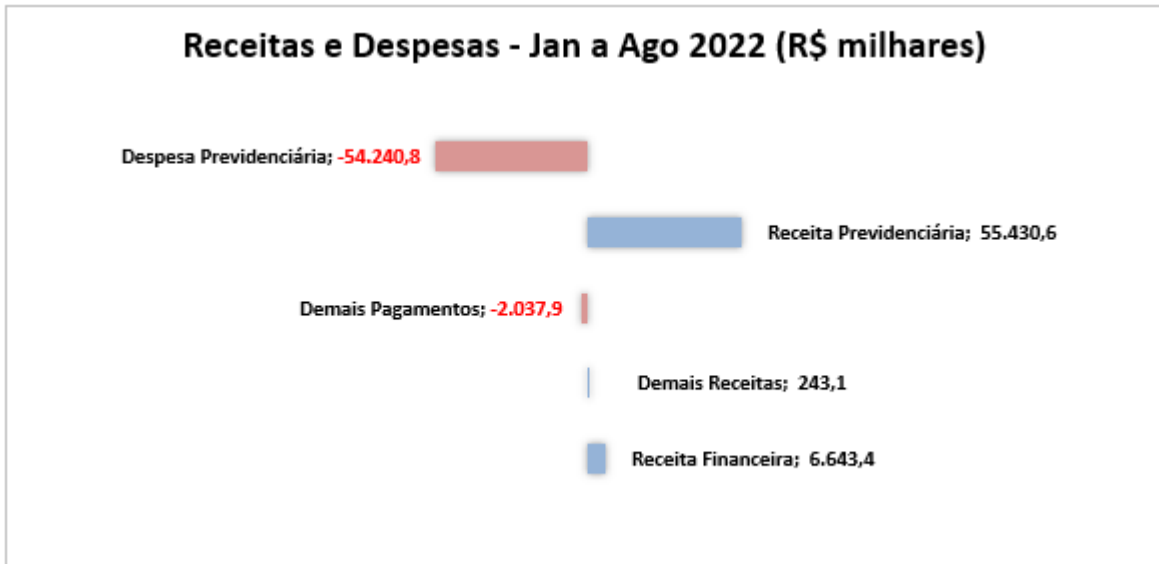
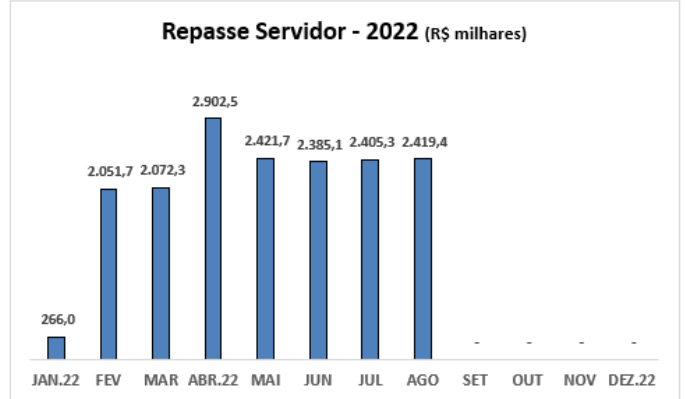
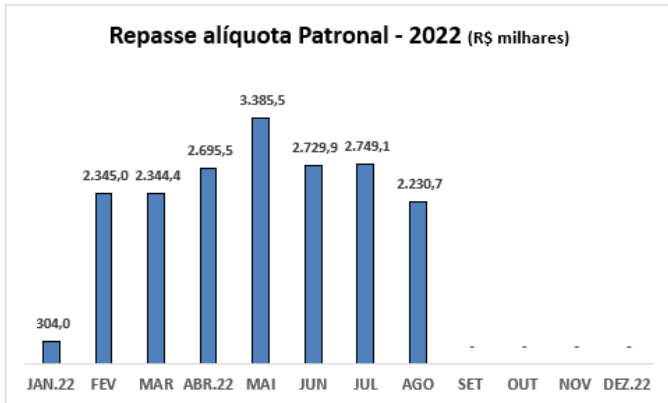
2020 - Resultado líquido mensal (R\$ milhares)



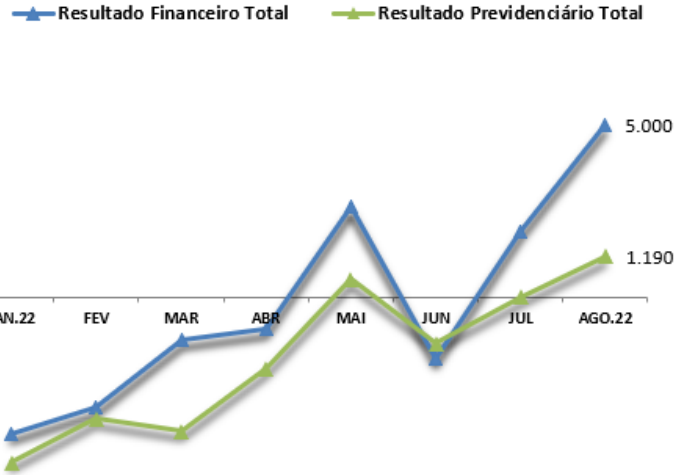
2020 - Resultado acumulado mensal (R\$ milhares)



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.



2022- Resultado acumulado mensal (R\$ milhares)



Segmentação das fontes de recursos - 01 a 08.2022 (R\$ milhares)



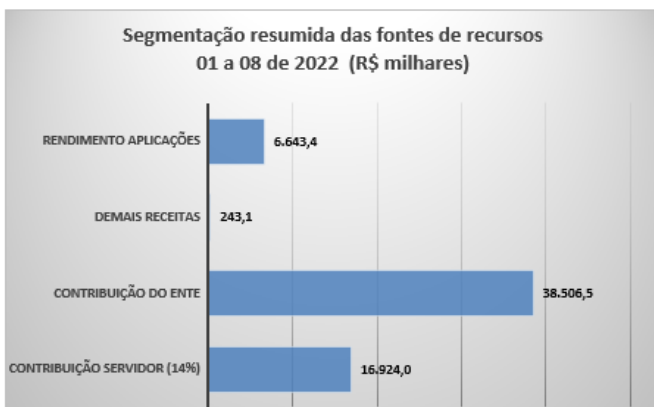
Fontes de recursos (jan/ago - 2022)

Fontes de recursos (jan/ago - 2022)	R\$ (milhares)
Pagamentos	57.317,3
Contribuição servidor (14%)	16.924,0
Contribuição ordinária patronal (16%)	18.784,1
Amortização Déficit (13,89%)	16.857,9
Parcelamento	1.460,7
Multa/Juros	1.403,9
Demais Receitas	243,1
Rendimento aplicações	6.643,4
Evolução do PL	7.281,2
Meta atuarial	13.423,9

11% dos recursos recebidos (aplicação para Rendimento aplicações)

19% dos recursos recebidos (aplicação para Evolução do PL)

Segmentação resumida das fontes de recursos 01 a 08 de 2022 (R\$ milhares)



Fontes de recursos (jan/ago - 2022)

Fontes de recursos (jan/ago - 2022)	R\$ (milhares)
Pagamentos	57.317,3
Contribuição servidor (14%)	16.924,0
Contribuição do Ente	38.506,5
Demais Receitas	243,1
Rendimento aplicações	6.643,4
Evolução anual do PL	7.281,18
Meta atuarial	13.423,9

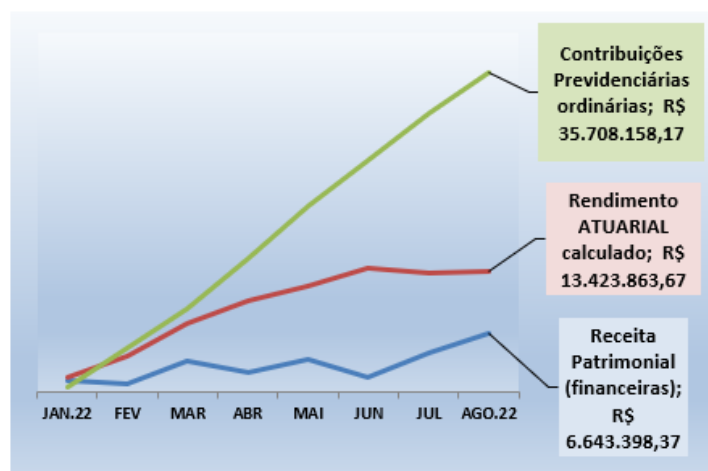
90% dos recursos recebidos (aplicação para Contribuição do Ente)

55.673,7 (aplicação para Pagamentos + Contribuição do Ente)

Quadro-resumo: Análise do Desempenho

	R\$ (milhares)
PL em 31/12/21	174.082,5
PL em 31/08/22	181.363,7
Evolução do PL (c/ despesas pagas)	7.281,2
Contribuições Previdenciárias do Ente	38.506,5
Contribuição Previdenciária do Servidor	16.924,0
Demais receitas	243,1
Rendimento de Aplicação Financeira	6.643,4
Rendimento Atuarial programado	13.423,9
Insuficiência financeira sobre a meta atuarial	- 6.780,5

2022 - Evolução das Receitas



8.2. Relatório de Governança Corporativa

Gestão de investimentos:

Resolução 4.963/2021
Ático Florestal FIC FIP
BB Ações Bolsas Européias ETF FIC Ações BDR Nível I
BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nível I
BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário
BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)
BB Nordea Invest. Ext. FIM
BB Previdenciário FI RF TP IPCA I
BB Previdenciário FI RF TP IPCA III
BB Previdenciário RF Perfil FIC
BBIF Master FIDC LP
BNB Seleção FIA
Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP
Caixa Bolsa Americana FI Multimercado LP
Caixa Brasil Disponibilidades RF FI
Caixa Brasil Estratégia Livre FIC Multimercado LP
Caixa Brasil IBX 50 FIA
Caixa Brasil IDkA 2A TP RF FI
Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP
Caixa Brasil Ref. DI FI LP
Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC
Caixa Brasil Título Público FI RF LP
Caixa FIA Institucional BDR Nível I
Caixa FIA SMALL CAPS Ativo
Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS
Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico
Caixa FIC FIA Multigestor
Caixa FIM RV 30 LP
CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE
FIC FI Capital Protegido Bolsa de Valores V Multimercado
HAZ FII (Ático Renda FII)
LME IPCA FIDC Multissetorial Senior